BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	17 Ene 22	18 Ene 22	19 Ene 22	20 Ene 22	21 Ene 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**14,074.2**	**13,010.3**	**12,042.1**	**12,496.4**	**10,194.4**
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	13,845.1	13,845.1	13,845.1	11,886.1	11,886.1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de Enero del 2022	1,959.0	1,959.0	1,959.0	2,040.0	2,040.0
Vencimiento de CD BCRP del 24 al 28 de Enero 2022	1,959.0	1,959.0	1,959.0	0.0	2,040.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5,363.3	5,363.3	5,463.3	5,363.3	5,463.3
Próximo vencimiento de Reso Valores el 24 de Enero del 2022	0.9	0.9	100.0	0.9	100.0
Vencimiento de Reso Valores del 24 al 28 de Enero 2022	0.0	0.0	100.0	0.0	100.9
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Reso de Cartera General	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Reso de Cartera General del 24 al 28 de Enero 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativa)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6,437.5	6,437.5	6,437.5	6,437.5	6,437.5
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativa el 3 de Febrero del 2022	1.5	1.5	1.5	1.5	1.5
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativa del 24 al 28 de Enero 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)					
Garantía para los créditos					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo adjudicado	53,399.9	53,399.9	53,399.9	53,399.9	53,399.9
vi. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)					
Garantía para los créditos					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo adjudicado	1,882.2	1,882.2	1,882.2	1,882.2	1,882.2
vii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO Especial - CDR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR					
Vencimiento de Reso Especial - CDR del 24 al 28 de Enero 2022					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	700.0	300.0	500.0	700.0	300.0
Propuestas recibidas	920.0	480.0	710.0	950.0	400.0
Plazo de vencimiento	91 d	90 d	89 d	95 d	94 d
Mínima	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
Máxima	0.04	0.04	0.04	0.04	0.04
Promedio	0.04	0.04	0.04	0.04	0.04
Saldo	13,914.3	14,214.3	14,714.3	15,414.3	15,714.3
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 28 de Enero del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de CDV BCRP del 24 al 28 de Enero 2022	n.n	n.n	n.n	n.n	200.0
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP					
Vencimiento de CDLD BCRP del 24 al 28 de Enero 2022					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1,685.5 / 9,600.0	1,401.5 / 8,548.6	1,951.0 / 8,094.5	1,735.0 / 7,305.7	972.2 / 7,508.2
Propuestas recibidas	7 d / 1 d	7 d / 1 d	7 d / 1 d	7 d / 1 d	7 d / 3 d
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima	2.92 / 2.90	2.93 / 2.86	2.92 / 2.75	2.93 / 2.81	2.92 / 2.82
Máxima	3.00 / 2.94	3.00 / 2.93	3.00 / 2.91	3.00 / 2.90	3.00 / 2.89
Promedio	2.99 / 2.91	2.99 / 2.89	2.99 / 2.87	2.99 / 2.88	2.99 / 2.88
Saldo	15,985.7	16,087.2	14,687.2	15,322.0	13,794.4
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 24 de Enero del 2022	9,100.0	9,800.1	8,200.2	8,800.0	7,885.6
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 24 al 28 de Enero 2022	14,300.2	13,000.2	9,900.2	8,800.0	13,794.4
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,637.3	4,637.3	4,637.3	4,637.3	4,637.3
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 21 de Febrero del 2022	1,000.0	1,000.0	1,000.0	1,000.0	1,000.0
Vencimiento de Coloc-TP del 24 al 28 de Enero 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc.- BN del 24 al 28 de Enero 2022					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)		200.0	200.0		
Propuestas recibidas		320.0	242.0		
Plazo de vencimiento		90 d	56 d		
Tasas de interés: Mínima		0.30	0.60		
Máxima		0.30	0.60		
Promedio		0.19	0.59		
Saldo	1,000.0	1,200.0	1,000.0	1,000.0	1,000.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 28 de Febrero del 2022	400.0	400.0	400.0	400.0	400.0
Vencimiento de CDR BCRP del 24 al 28 de Enero 2022	400.0	400.0	n.n	n.n	n.n
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimiento de CD BCRP del 24 al 28 de Enero 2022					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Danclar)					300.0
Propuestas recibidas					420.0
Plazo de vencimiento					14 d
Tasas de interés: Mínima					3.62
Máxima					3.62
Promedio					3.62
Saldo	2,641.9	2,641.9	2,641.9	2,441.9	2,641.9
Próximo vencimiento de Danclar el 28 de Enero del 2022	200.0	200.0	200.0	100.0	100.0
Vencimiento de REPO del 24 al 28 de Enero 2022	200.0	200.0	200.0	0.0	100.0
xvi. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso					
Vencimiento de REPO del 24 al 28 de Enero 2022					
xvii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 24 al 28 de Enero 2022					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 24 al 28 de Enero 2022					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		300.0 / 300.0	200.0		
Propuestas recibidas		670.0 / 823.0	370.0		
Plazo de vencimiento		365 d / 273 d	90 d		
Tasas de interés: Mínima		0.40 / 0.39	0.29		
Máxima		0.45 / 0.39	0.60		
Promedio		0.44 / 0.39	0.49		
Saldo	37,889.2	38,489.2	38,534.2	38,534.2	38,534.2
Próximo vencimiento de SC Venta el 24 de Enero del 2022	155.0	155.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de SC Venta del 24 al 28 de Enero 2022	155.0	155.0	0.0	0.0	200.0
xx. Subasta de Reso de Valores para proveer dólares (RED)		50.0			
Propuestas recibidas		50.0			
Plazo de vencimiento		14 d			
Tasas de interés: Mínima		0.30			
Máxima		0.30			
Promedio		0.30			
Saldo	130.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Próximo vencimiento de RED el 27 de Enero del 2022	80.0	50.0	50.0	50.0	50.0
Vencimiento de RED del 24 al 28 de Enero 2022	80.0	0.0	0.0	0.0	50.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	50.0	50.0			50.0
Propuestas recibidas	90.0	110.0			173.0
Plazo de vencimiento	90 d	181 d			273 d
Tasas de interés: Mínima	3.31	3.76			3.88
Máxima	3.31	3.81			3.88
Promedio	3.31	3.80			3.88
Saldo	20,069.9	20,019.9	19,969.9	19,969.9	19,919.9
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 24 de Febrero del 2022	100.0	50.0	100.0	100.0	300.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 24 al 28 de Enero 2022	250.0	150.0	100.0	100.0	0.0
b. Liquid. Repos Cartera de Créditos (Circular 001-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)					
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	46.4	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)		12.0			
Tipo de cambio promedio		3.8700			
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	0.0	0.1	0.1	0.3
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.1	0.1	0.3
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valoración)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4,098.7**	**3,282.4**	**3,042.0**	**2,961.4**	**2,922.0**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swap)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0091%	0.0091%	0.0091%	0.0091%	0.0092%
b. Compra temporal de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3.50%	3.50%	3.50%	3.50%	3.50%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,413.0	1,792.0	1,397.8	1,689.0	1,771.0
Tasa de interés	1.85%	1.85%	1.85%	1.85%	1.85%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,675.7**	**1,475.4**	**1,644.2**	**1,272.4**	**1,151.0**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	11,625.7	11,379.8	11,202.1	11,088.0	10,881.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TPOR) (*)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4,883.6	4,642.6	4,464.8	4,332.5	4,169.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.5	2.4	2.3	2.2	2.1
6. Operaciones de la vista con el público en moneda nacional de COBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	276.0	526.0	444.0	712.0	840.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBR*	3.00 / 3.00 / 3.00	3.00 / 3.00 / 3.00	3.00 / 3.00 / 3.00	3.00 / 3.00 / 3.00	3.00 / 3.00 / 3.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	65.0	20.0	20.0	20.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	
c. Total mercado secundario de COBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.8	0.0	204.1	0.0	0.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**Ene.14, 2022**	**Ene.17, 2022**	**Ene.18, 2022**	**Ene.19, 2022**	**Ene.20, 2022**
Efecto de la posición global	-14.5	-17.6	104.9	49.4	39.1
Flujo de la posición contable	16.5	-22.4	104.5	-26.7	-130.1
a. Mercado spot con el público	54.0	13.1	46.0	14.7	-145.8
i. Compras	345.5	254.3	467.6	335.2	308.8
ii. (-) Ventas	291.5	241.2	421.6	320.5	454.6
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	87.8	27.3	-163.5	29.1	-155.6
i. Pactadas	146.6	29.7	208.7	243.5	359.4
ii. (-) Vencidas	58.9	2.5	372.3	214.4	515.1
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	-8.4	18.3	-5.4	81.5	-325.5
i. Pactadas	334.6	100.8	255.5	229.2	353.5
ii. (-) Vencidas	343.9	82.5	260.9	147.6	679.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	156.5	76.6	439.3	243.7	461.3
ii. A futuro	2.1	0.0	46.5	4.0	164.5
e. Operaciones swap asociadas a swaps o vencimientos de forwards sin entrega	282.1	55.3	-118.3	-57.4	164.5
i. Compras	338.1	56.0	247.4	143.5	673.0
ii. (-) Ventas	56.0	0.6	365.7	200.9	508.5
f. Efecto de Opciones	-0.1	-4.2	2.8	-1.7	0.3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-162.5	-10.8	219.2	-38.3	-4.8
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.8726	3.8512	3.8531	3.8651	3.8549

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera