BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	21 Feb 22	22 Feb 22	23 Feb 22	24 Feb 22	25 Feb 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**13,974.2**	**13,657.0**	**11,411.4**	**12,602.1**	**15,394.6**
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	6,277.4	6,277.4	6,277.4	6,123.4	6,123.4
Próximo vencimiento de CD BCRP al 3 de Marzo del 2022	154.0	154.0	154.0	120.0	120.0
Vencimiento de CD BCRP del 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022	154.0	154.0	154.0	0.0	120.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5,362.4	5,362.4	5,362.4	5,462.4	5,362.4
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 18 de Abril del 2022	500.0	500.0	500.0	100.0	500.0
Vencimiento de Reso Valores del 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	100.0	0.0
iii. Subasta de Correo 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 28 de Febrero al 4 de Marzo de 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	6,432.3	6,432.3	6,432.3	6,432.3	6,428.4
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativa al 4 de Marzo del 2022	3.9	3.9	3.9	3.9	3.9
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativa del 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022	3.9	3.9	3.9	3.9	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 Repo Especial - CDR del 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	900.0	355.0		200.0	999.9
Propuestas recibidas	1010.0	355.0		294.0	1499.0
Plazo de vencimiento	7.0	14.0		28.0	28.0
Tasas de interés: Mínima	0.04	0.04		0.04	0.04
Máxima	0.04	0.04		0.04	0.04
Promedio	0.04	0.04		0.04	0.04
Saldo	19,382.6	19,737.6	19,737.6	19,937.6	19,217.7
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 7 de Marzo del 2022	1,718.8	1,718.8	1,718.8	1,718.8	2,000.1
Vencimiento de CDV BCRP del 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022	1,718.8	1,718.8	1,718.8	1,718.8	0.0
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 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (TIC BCSD)	2,700.0 7,687.4	2,700.0 9,236.0	600.0 9,700.1	1,700.0 9,987.0	2,700.0 10,607.9
Propuestas recibidas	2,452.0 7,687.4	2,607.1 10,236.0	1,222.5 9,683.7	1,708.0 9,387.0	2,170.0 10,607.9
Plazo de vencimiento	7.0 1.0	7.0 1.0	7.0 1.0	7.0 1.0	7.0 3.0
Tasas de interés: Mínima	3.43 3.25	3.45 3.30	3.46 3.30	3.46 3.29	3.46 3.30
Máxima	3.50 3.50	3.50 3.45	3.50 3.40	3.50 3.50	3.50 3.50
Promedio	3.49 3.33	3.49 3.34	3.49 3.34	3.49 3.35	3.49 3.34
Saldo	17,164.0	18,376.8	17,900.3	18,087.2	18,700.2
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 28 de Febrero del 2022	10,687.4	10,276.6	10,400.1	11,887.0	12,700.1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022	14,963.9	13,976.6	12,900.1	11,887.0	18,700.2
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	500.0	500.1			
Propuestas recibidas	1998.5	1996.4			
Plazo de vencimiento	179.0	185.0			
Tasas de interés: Mínima	4.35	4.39			
Máxima	5.40	5.50			
Promedio	4.58	4.48			
Saldo	4,157.5	4,657.4	4,657.4	4,657.4	4,657.4
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 28 de Febrero del 2022	500.1	500.1	500.1	500.1	500.1
Vencimiento de Coloc- TP del 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	500.1
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN del 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,400.0	1,400.0	1,400.0	1,400.0	1,400.0
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 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	400.0
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					
Vencimientos de CD BCRP del 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2,052.0	2,052.0	2,052.0	2,452.0	2,452.0
Próximo vencimiento de Repo Regular al 4 de Marzo del 2022	230.0	230.0	230.0	230.0	230.0
Vencimiento de REPO del 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	230.0
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 28 de Febrero al 4 de Marzo de 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 28 de Febrero al 4 de Marzo de 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 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	40,494.2	40,494.2	40,494.2	40,494.2	40,494.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 18 de Marzo del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de SC-Venta del 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xx. Subasta de Reso de Valores para proveer dólares (RED)					
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 RED el 27 de Febrero del 2022					
Vencimiento de RED del 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	50.0	50.0			50.0
Propuestas recibidas	150.0	200.0			150.0
Plazo de vencimiento	89.0	181.0			273.0
Tasas de interés: Mínima	4.00	4.28			4.40
Máxima	4.05	4.29			4.44
Promedio	4.03	4.29			4.42
Saldo	20,544.9	20,594.9	20,594.9	20,294.9	19,945.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 28 de Febrero del 2022	300.0	300.0	300.0	399.9	400.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 28 de Febrero al 4 de Marzo de 2022	699.9	699.9	699.9	399.9	1,450.0
b. Liquid. Repos Cartera de Créditos (Circular 0016-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)					
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	-3.8	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	1.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	3.7500	0.0000	0.0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.4	0.8	0.5	0.7	0.7
i. Compras (millones de US$)	0.4	0.8	0.5	0.7	0.7
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3,386.7**	**1,901.9**	**1,615.1**	**2,215.1**	**1,894.7**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swap)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0120%	0.0121%	0.0122%	0.0119%	0.0111%
b. Compra temporal de valores (Repos de subasta)					
Tasa de interés	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Desdobles Overnight en moneda nacional	2,449.9	1,045.2	889.2	1,297.0	961.0
Tasa de interés	2.25%	2.25%	2.25%	2.25%	2.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**936.8**	**856.7**	**725.9**	**918.1**	**933.7**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	11,463.9	11,295.4	11,134.0	10,976.1	10,857.7
b. Exceso de encaje en moneda nacional promedio acumulado (M. del TESDE) (*)	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4,613.9	4,446.7	4,287.1	4,133.3	4,012.4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TESDE) (*)	2.4	2.3	2.2	2.1	2.1
6. Mercado secundario de Certificados de Depósitos del CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	400.8	840.9	706.9	564.0	615.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBN	5.40 / 5.50 / 5.50	5.40 / 5.50 / 5.50	5.40 / 5.50 / 5.50	5.40 / 5.50 / 5.50	5.40 / 5.50 / 5.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	165.5	111.5	58.0	45.0	30.0
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	0.25 / 0.25 / 0.25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	1.9	0.0	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$)	**Feb.18, 2022**	**Feb.21, 2022**	**Feb.22, 2022**	**Feb.23, 2022**	**Feb.24, 2022**
Efecto de la volatilidad cambiaria en la posición global	-76.6	48.5	4.5	-77.3	-55.8
Flujo de la posición contable (= a + b + c + d + e + f + g)	10.3	79.8	39.5	-102.7	36.0
a. Mercado spot con el público	-23.7	66.0	44.6	-99.6	51.5
i. Compras	459.7	242.8	494.8	481.4	520.1
ii. (-) Ventas	483.3	176.8	440.1	581.0	468.6
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	48.3	98.8	-118.9	81.7	-171.2
i. Pactadas	347.1	144.1	408.0	321.1	536.3
ii. (-) Vencidas	298.7	45.3	524.9	239.4	707.5
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	151.9	117.9	-94.3	51.7	-74.6
i. Pactadas	274.1	145.8	383.9	246.3	537.5
ii. (-) Vencidas	122.2	27.9	468.3	194.6	612.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	447.5	246.1	268.3	458.9	671.6
ii. A futuro	95.0	0.0	8.0	3.0	0.0
e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-156.0	-3.5	-53.8	-45.3	-111.0
i. Compras	119.3	12.2	461.9	192.6	570.7
ii. (-) Ventas	275.3	15.8	515.6	237.9	681.7
f. Efecto de Opciones	-0.2	-2.1	-2.3	-4.5	4.8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	67.2	-0.1	-8.0	-2.5	0.1
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7181	3.7515	3.7421	3.7162	3.7966

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera