BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	07 Mar 22	08 Mar 22	09 Mar 22	10 Mar 22	11 Mar 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**21,773.8**	**21,146.5**	**20,827.4**	**21,484.4**	**20,652.8**
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 BCRP)					1000.0
Propuestas recibidas					1714.7
Plazo de vencimiento					31 d
Tasas de interés: Mínima					3.85
Máxima					3.95
Promedio					3.95
Saldo	4,508.4	4,508.4	4,508.4	4,508.4	5,856.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 18 de Marzo del 2022	2,251.8	2,251.8	2,251.8	2,251.8	2,251.8
Vencimiento de CD BCRP del 14 al 18 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	2,251.8
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	100.0	100.0			
Propuestas recibidas	765.0	765.0			
Plazo de vencimiento	7 d	1 d			
Tasas de interés: Mínima	4.25	3.95			
Máxima	4.25	3.95			
Promedio	4.25	3.95			
Saldo	5,457.4	5,457.4	5,457.4	5,457.4	5,457.4
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 18 de Abril del 2022	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de Reso Valores del 14 al 18 de Marzo de 2022	0.0	100.0	0.0	0.0	100.0
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 14 al 18 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	6,428.4	6,428.4	6,428.4	6,428.4	6,428.4
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativa el 6 de Junio del 2022	14.5	14.5	14.5	14.5	14.5
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativa del 14 al 18 de Marzo de 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 (Resulta)					
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 14 al 18 de Marzo de 2022					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	1000.0	999.9			500.0
Propuestas recibidas	1822.0	1075.8			1088.0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d			1 d
Mínimo: Mínima	0.04	0.04			0.03
Máxima	0.04	0.04			0.04
Promedio	0.04	0.04			0.03
Saldo	19,717.5	20,717.5	20,717.5	20,717.5	21,217.5
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 18 de Marzo del 2022	2,199.9	2,199.9	2,199.9	2,199.9	2,199.9
Vencimientos de CDV BCRP del 14 al 18 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	2,199.9
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 14 al 18 de Marzo de 2022					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	12,600.0	12,500.1	13,200.0	14,200.0	2,499.9 10,800.0
Propuestas recibidas	14,316.9	14,101.0	15,344.4	15,313.7	4,835.8 14,442.1
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	7 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	3.28	3.30	3.30	3.30	3.80 3.35
Máxima	3.50	3.50	3.42	3.41	4.00 3.88
Promedio	3.42	3.42	3.40	3.38	3.99 3.82
Saldo	14,310.6	13,674.6	13,200.0	14,200.0	13,299.9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 18 de Marzo del 2022	13,136.1	13,674.6	13,200.0	14,200.0	10,800.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 14 al 18 de Marzo de 2022	14,310.6	13,674.6	13,200.0	14,200.0	13,299.9
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,632.4	4,632.4	4,632.4	4,632.4	4,632.4
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 18 de Marzo del 2022	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 14 al 18 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	300.0
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 14 al 18 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	1,195.0	1,195.0	1,195.0	1,195.0	1,195.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 18 de Marzo del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de CDR BCRP del 14 al 18 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	200.0
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 14 al 18 de Marzo de 2022					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resulta)	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Propuestas recibidas	483.0	405.0	365.0	267.0	375.0
Plazo de vencimiento	7 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	4.75	4.10	3.90	3.90	4.55
Máxima	4.70	4.10	4.01	3.95	4.50
Promedio	4.70	4.10	3.92	3.83	4.37
Saldo	3,022.0	2,922.0	2,922.0	2,522.0	2,222.0
Próximo vencimiento de Repo Resulta el 21 de Marzo del 2022	300.0	200.0	600.0	500.0	400.0
Vencimiento de REPO del 14 al 18 de Marzo de 2022	1,000.0	900.0	900.0	500.0	400.0
xvi. Compra Moneda Nacional con compromiso de recompra					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo					
Vencimiento de REPO del 14 al 18 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 Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 14 al 18 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 Repo Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 14 al 18 de Marzo de 2022					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	41,094.2	41,094.2	41,094.2	41,094.2	41,094.2
Próximo vencimiento de SC - Venta del 18 de Marzo del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de SC - Venta del 14 al 18 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	200.0
xx. Subasta de Repo de bonos para proveer dólares (REDI)					
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 REDI el 14 de Marzo del 2022					
Vencimiento de REDI del 14 al 18 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			350.0
Plazo de vencimiento	91 d	184 d			275 d
Tasas de interés: Mínima	4.48	4.49			4.83
Máxima	4.77	4.49			4.84
Promedio	4.21	4.49			4.83
Saldo	17,245.0	17,295.0	17,295.0	16,895.0	16,945.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 15 de Marzo del 2022	400.0	400.0	400.0	450.0	450.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 14 al 18 de Marzo de 2022	400.0	400.0	400.0	0.0	1,000.0
b. Overall Banco Central de Crédito (Overnight (OCR), TOMN, BCRP, Overnight (BRCP), TOMN, BCRP y Overnight (BRP), TOMN, BCRP)					
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**8,473.8**	**7,946.5**	**7,527.4**	**7,484.4**	**6,652.8**
4. Operaciones monetarias del BCR casa el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swap)	0.01775%	0.01775%	0.01775%	0.01775%	0.01775%
Promedio (tasa efectiva diaria)					
b. Compra temporal de valores (Tasa de subasta)	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%
Tasa de interés					
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	96.1	78.1	1,557.5	660.0	2,358.5
Tasa de interés	2.25%	2.25%	2.25%	2.25%	2.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**8,377.7**	**7,928.4**	**6,319.9**	**6,924.4**	**3,794.5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	14,625.7	14,611.4	12,314.1	14,582.4	14,012.9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.7	7.8	6.3	7.6	7.6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7,409.5	7,693.3	7,667.7	7,575.0	7,566.5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.9	4.0	4.0	3.9	3.9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	523.0	863.0	264.0	844.0	799.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	3.60 / 3.65/ 3.64	3.60 / 3.65/ 3.61	3.50 / 3.60 / 3.55	3.50 / 3.70 / 3.69	4.00 / 4.00 / 4.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	346.5	177.5	195.5	354.5	367.5
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	0.0	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$)	**Mar. 04, 2022**	**Mar. 07, 2022**	**Mar. 08, 2022**	**Mar. 09, 2022**	**Mar. 10, 2022**
Flujo de la posición diaria: = a + b i - c i + e + f + o	16.6	6.6	-60.1	-104.4	131.1
Flujo de la posición contable = a + b i - c ii + e + g	2.2	-127.7	-73.6	-120.3	-120.5
a. Mercado spot con el público	13.8	-98.4	-15.3	-125.9	-85.2
i. Compras	339.1	351.8	369.4	363.9	439.8
ii. (-) Ventas	325.4	450.2	383.7	489.8	525.0
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-124.7	175.7	77.6	113.3	84.4
i. Pactadas	161.3	411.5	508.7	393.6	392.1
ii. (-) Vencidas	286.0	235.8	431.1	280.3	307.7
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-139.4	42.7	64.1	98.0	-153.3
i. Pactadas	183.9	199.2	369.3	302.8	179.8
ii. (-) Vencidas	323.4	156.5	305.2	204.8	333.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	396.2	242.4	377.5	357.7	478.5
ii. A futuro	54.0	73.0	110.5	85.0	176.0
e. Operaciones sont asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	40.9	-96.4	-184.2	-67.9	8.6
i. Compras	313.3	132.1	244.8	203.7	308.0
ii. (-) Ventas	272.3	228.6	429.0	271.6	299.4
f. Efecto de Opciones	-0.3	1.3	0.0	0.6	13.9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-15.1	-12.2	0.0	-1.9	-18.5
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7525	3.7432	3.7251	3.7147	3.7158
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera