BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	4 Abr 22	5 Abr 22	6 Abr 22	7 Abr 22	8 Abr 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**7 655.6**	**8 112.3**	**8 983.7**	**9 203.8**	**9 227.3**
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	7 165.7	7 165.7	7 165.7	7 044.8	7 044.8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 18 de Abril del 2022	120.9	120.9	120.9	7 044.8	7 044.8
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 13 de Abril de 2022	120.9	120.9	120.9	0.0	2 008.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	300.0	800.0	800.0 500.0	800.0 1000.0	800.0
Propuestas recibidas	1100.0	3600.0	3600.0 1700.0	1800.0 5400.0	3600.0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	4.85	4.85	4.85 4.65	4.75 4.87	4.55
Máxima	4.85	4.95	4.75 4.60	4.85 4.91	4.87
Promedio	4.85	4.83	4.67 4.60	4.84 4.88	4.71
Saldo	4 567.4	4 567.4	4 567.4	7 167.4	6 167.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 18 de Abril del 2022	300.0	1 200.0	1 300.0	1 800.0	800.0
Vencimiento de Repo Valores del 11 al 13 de Abril de 2022	900.0	1 500.0	1 500.0	1 800.0	800.0
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 Repo de Cartera General	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Repo de Cartera General del 11 al 13 de Abril de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 425.3	6 425.3	6 425.3	6 425.3	6 425.3
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Junio del 2022	13.9	13.9	13.9	13.9	13.9
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 11 al 13 de Abril 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 (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 11 al 13 de Abril de 2022					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Márgen: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	19 817.7	19 817.7	19 817.7	19 817.7	19 817.7
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 18 de Abril del 2022	2 000.0	2 000.0	2 000.0	2 000.0	2 000.0
Vencimientos de CDV BCRP del 11 al 13 de Abril de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	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 11 al 13 de Abril de 2022					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	400.0	800.0	2 300.0	2 991.2	3 500.0
Propuestas recibidas	1 355.3	1 923.1	3 358.7	2 991.2	4 977.9
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	3.50	3.10	3.95	3.95	3.10
Máxima	3.30	3.21	3.81	4.00	4.50
Promedio	3.35	3.16	3.91	3.44	3.11
Saldo	4 043.8	2 950.8	3 260.0	2 991.2	3 500.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 11 de Abril del 2022	1 893.0	2 050.8	3 200.0	2 991.2	3 500.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 11 al 13 de Abril de 2022	4 043.8	2 950.8	3 260.0	2 991.2	3 500.0
xi. Subasta de Colocación DP en MN del Tesoro Público (COLOCBP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 499.4	4 499.4	4 499.4	4 499.4	4 499.4
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 9 de Mayo del 2022	500.0	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de Coloc-TP del 11 al 13 de Abril de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xii. Subasta de Colocación DP en MN 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 11 al 13 de Abril de 2022					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reguistrables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	595.0	595.0	595.0	595.0	595.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 13 de Abril del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de CDR BCRP del 11 al 13 de Abril de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	300.0
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					
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 13 de Abril de 2022					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	500.0	600.0 500.0	500.0	400.0	400.0
Propuestas recibidas	1428.0	1482.0 1297.3	1383.0	1327.0	740.0
Plazo de vencimiento	1 d	7 d 7 d	7 d	6 d	10 d
Tasas de interés: Mínima	5.15	5.45 5.50	5.17	5.25	5.25
Máxima	5.56	5.60 5.55	5.56	5.43	5.45
Promedio	5.15	5.48 5.50	5.38	5.38	5.17
Saldo	1 922.0	2 422.0	2 422.0	2 822.0	3 222.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 12 de Abril del 2022	300.0	300.0	900.0	900.0	900.0
Vencimiento de REPO del 11 al 13 de Abril de 2022	600.0	300.0	0.0	0.0	1 600.0
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera con compromiso de reventa					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo					
Vencimiento de REPO del 11 al 13 de Abril 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 11 al 13 de Abril 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 11 al 13 de Abril de 2022					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	20.0 70.0	200.0 40.0	200.0 200.0 200.0		200.0
Propuestas recibidas	255.0 125.0	215.0 102.0	260.0 240.0 330.0		325.0
Plazo de vencimiento	97 d 365 d	365 d 275 d	275 d 364 d		367 d
Tasas de interés: Mínima	0.60 1.70	1.70 1.40	1.40 1.69 1.65		1.75
Máxima	0.60 1.70	1.75 1.40	1.65 1.69 1.75		1.85
Promedio	0.60 1.70	1.73 1.40	1.45 1.69 1.70		1.77
Saldo	35 136.1	34 901.1	35 301.1	35 301.1	35 072.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 12 de Abril del 2022	475.0	200.0	428.2	428.2	240.0
Vencimiento de SC - Venta del 11 al 13 de Abril de 2022	1 103.2	628.2	428.2	428.2	667.0
xx. Subasta de Repo de Valores 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					
Vencimiento de REDI del 11 al 13 de Abril de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	100.0	100.0			100.0
Propuestas recibidas	300.0	300.0			300.0
Plazo de vencimiento	91 d	183 d			275 d
Tasas de interés: Mínima	4.95	5.75			5.40
Máxima	4.95	5.75			5.40
Promedio	4.85	5.31			5.38
Saldo	11 295.1	11 495.1	11 495.1	11 495.1	11 595.1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 15 de Abril del 2022	400.0	50.0	50.0	50.0	50.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 11 al 13 de Abril de 2022	400.0	0.0	0.0	0.0	100.0
b. Liquid. Repos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)					
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	547.8	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	548.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	3.7016	0.0000	0.0000	0.0000
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.2	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	3.7000	0.0000	0.0000	0.0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.3	0.2	0.1	0.0	1.1
i. Compras (millones de US$)	0.3	0.2	0.1	0.0	1.1
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**7 855.6**	**8 464.5**	**8 283.7**	**8 532.6**	**6 927.3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0.01770%	0.01770%	0.01770%	0.01770%	0.01770%
Comisión (tasa efectiva diaria)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%
c. Créditos por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	364.4	495.7	334.7	366.0	567.8
Tasa de interés	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%	3.00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**7 591.2**	**8 029.3**	**7 949.5**	**8 166.6**	**6 359.5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13 027.8	13 941.7	14 269.8	14 463.7	14 692.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.8	7.3	7.5	7.6	7.7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 375.0	4 365.5	6 676.7	6 784.9	6 554.0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.8	2.3	3.5	3.6	3.4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 465.4	1 678.7	2 131.0	2 597.4	1 988.0
Saldo al mes (monto / tasa promedio)	1 801.4 3.50	1 801.4 3.15	1 801.4 3.50	1 801.4 3.50	1 801.4 3.51
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio			0.50 / 0.50 / 0.50	0.50 / 0.50 / 0.50	
c. Total mercado secundario de COBCRP, COBCRP-NR y CDV	355.8	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$)	**Abril.01, 2022**	**Abril.04, 2022**	**Abril.05, 2022**	**Abril.06, 2022**	**Abril.07, 2022**
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	12.3	-91.8	108.3	-49.2	-21.5
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + g	49.8	-53.4	398.9	107.1	234.3
a. Mercado spot con el público	69.6	89.4	249.5	105.3	274.1
i. Compras	599.3	739.5	744.4	550.0	731.5
ii. (-) Ventas	520.7	650.1	494.9	394.7	457.4
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	100.6	84.3	-292.4	-11.6	-403.9
i. Pactadas	225.8	288.2	200.7	122.6	339.9
ii. (-) Vencidas	125.2	204.0	493.1	134.2	743.8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	42.5	75.2	-53.1	257.2	-144.7
i. Pactadas	414.3	237.9	333.1	552.7	498.8
ii. (-) Vencidas	371.9	162.6	386.1	295.5	643.5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	309.4	450.0	310.7	288.1	603.0
ii. A futuro	20.0	68.0	20.0	103.0	168.8
e. Operaciones sont asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entrega	244.1	-78.2	-107.4	166.5	-134.0
i. Compras	355.1	123.6	374.0	292.7	602.9
ii. (-) Ventas	111.0	201.9	481.4	126.2	736.9
f. Efecto de Decisiones	1.2	10.1	5.0	1.5	3.5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-114.0	-163.4	93.5	107.5	-6.1
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6430	3.6267	3.6999	3.7114	3.7114
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera