BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	25 Abr 22	26 Abr 22	27 Abr 22	28 Abr 22	29 Abr 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**3 877,0**	**5 482,6**	**5 557,5**	**5 084,6**	**6 218,0**
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	7 609,0	7 609,0	7 609,0	7 609,0	7 609,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de Mayo del 2022	1 775,0	1 775,0	1 775,0	1 775,0	1 775,0
Vencimiento de CD BCRP del 2 al 6 de Mayo de 2022	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1000,0 200,0 300,0	1000,0 200,0 200,0	200,0	300,0 700,0	200,0 700,0
Propuestas recibidas	1660,0 1000,0 300,0	2050,0 620,0 700,0	620,0	1000,0 2200,0	600,0 2200,0
Plazo de vencimiento	1 d 32 d 1 d	1 d 90 d 31 d	89 d	29 d 7 d	87 d 7 d
Tasas de interés: Mínima	5,38 5,25 5,45	5,31 5,61 5,38	5,77	5,55 5,45	5,81 5,54
Máxima	5,41 5,26 5,45	5,43 5,61 5,38	5,77	5,58 5,49	5,84 5,54
Promedio	5,40 5,26 5,45	5,34 5,61 5,38	5,77	5,57 5,47	5,83 5,54
Saldo	5 162,4	6 562,4	5 762,4	5 762,4	6 662,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 5 de Mayo del 2022	1 000,0	1 000,0	1 000,0	700,0	700,0
Vencimiento de Repo Valores del 2 al 6 de Mayo de 2022	1 000,0	2 000,0	1 000,0	0,0	1 400,0
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 2 al 6 de Mayo 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	6 421,4	6 421,4	6 421,4	6 421,4	6 421,4
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Junio del 2022	13,3	13,3	13,3	13,3	13,3
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 2 al 6 de Mayo 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 2 al 6 de Mayo de 2022					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	500,0	500,0			
Propuestas recibidas	500,0	799,4			
Plazo de vencimiento	91 d	90 d			
Márgen: Mínima	0,03	0,03			
Máxima	0,03	0,04			
Promedio	0,03	0,03			
Saldo	18 167,6	18 667,6	18 667,6	18 667,6	18 667,6
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 9 de Mayo del 2022	550,0	550,0	550,0	550,0	550,0
Vencimientos de CDV BCRP del 2 al 6 de Mayo 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 2 al 6 de Mayo de 2022					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 300,0	4 107,3	4 267,4	4 346,3	4 589,6
Propuestas recibidas	3 670,6	4 107,3	4 267,4	4 346,3	4 589,6
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	2,85	3,00	3,05	3,05	3,05
Máxima	3,30	4,50	4,50	4,50	4,50
Promedio	3,16	3,64	4,11	4,29	4,29
Saldo	346,0	4 453,3	4 267,4	4 346,3	4 589,6
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 2 de Mayo del 2022	346,0	4 453,3	4 267,4	4 346,3	4 589,6
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 2 al 6 de Mayo de 2022	300,0	4 453,30	4 267,4	4 346,3	300,0
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300,0		300,0	300,0	300,0
Propuestas recibidas	865,0		999,0	704,2	661,2
Plazo de vencimiento	183 d		184 d	188 d	189 d
Tasas de interés: Mínima	5,76		5,92	5,96	5,92
Máxima	6,00		5,99	6,07	6,20
Promedio	5,81		5,96	6,02	5,99
Saldo	5 169,4	5 169,4	5 469,4	5 769,4	6 069,4
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 2 al 6 de Mayo de 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 2 al 6 de Mayo 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	195,0	195,0	195,0	195,0	195,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 27 de Mayo del 2022	195,0	195,0	195,0	195,0	195,0
Vencimiento de CDR BCRP del 2 al 6 de Mayo de 2022	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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 2 al 6 de Mayo de 2022					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	300,0	300,0	200,0 200,0	200,0	300,0
Propuestas recibidas	660,0	630,0	830,0 700,0	998,8	1269,0
Plazo de vencimiento	7 d	7 d	30 d 7 d	90 d	31 d
Tasas de interés: Mínima	5,46	5,46	5,63 5,66	5,63	5,70
Máxima	5,70	5,75	5,90 5,66	6,14	5,72
Promedio	5,47	5,48	5,70 5,66	5,83	5,71
Saldo	2 122,0	2 422,0	2 822,0	2 682,0	2 682,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 2 de Mayo del 2022	340,0	340,0	340,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO del 2 al 6 de Mayo de 2022	640,0	640,0	640,0	300,0	805,0
xvi. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo					
Vencimiento de REPO del 2 al 6 de Mayo 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 2 al 6 de Mayo 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 2 al 6 de Mayo de 2022					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200,0 200,0 120,0 15,0	200,0 200,0 200,0 200,0	200,0 185,0 200,0 200,0	200,0 200,0	
Propuestas recibidas	421,0 306,0 170,0 105,0	363,0 564,0 435,0 465,0	290,0 185,0 645,0 650,0	445,0 300,0	
Plazo de vencimiento	91 d 183 d 365 d 92 d	91 d 91 d 92 d 365 d	183 d 365 d 365 d 183 d	90 d 183 d	
Tasas de interés: Mínima	0,85 1,40 1,99 0,95	0,84 0,84 0,45 1,45	1,50 2,00 1,82 1,20	0,90 1,21	
Máxima	0,95 1,42 2,10 0,95	0,95 0,85 0,50 1,48	1,55 2,10 1,90 1,25	0,94 1,54	
Promedio	0,89 1,40 2,05 0,95	0,84 0,84 0,48 1,47	1,52 2,06 1,86 1,22	0,91 1,36	
Saldo	33 197,0	33 997,0	34 522,0	34 922,0	34 762,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 2 de Mayo del 2022	460,0	460,0	160,0	160,0	160,0
Vencimiento de SC - Venta del 2 al 6 de Mayo de 2022	620,0	620,0	160,0	160,0	878,0
xx. Subasta de Repo 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					
Vencimiento de RED del 2 al 6 de Mayo de 2022	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	100,0	100,0			50,0
Propuestas recibidas	200,0	200,0			150,0
Plazo de vencimiento	91 d	183 d			275 d
Tasas de interés: Mínima	5,23	5,49			5,63
Máxima	5,23	5,49			5,63
Promedio	5,23	5,49			5,63
Saldo	10 995,1	11 095,1	10 995,1	10 895,1	10 745,1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 2 de Mayo del 2022	100,0	100,0	100,0	200,0	50,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 2 al 6 de Mayo de 2022	400,0	400,0	300,0	200,0	700,0
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	-939,2	0,0	0,0	-7,7	0,0
i. Compras (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
ii. Ventas (millones de US$)	246,0	0,0	0,0	2,0	0,0
Tipo de cambio promedio	3,8180	0,0000	0,0000	3,8680	0,0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	14,2	14,2	0,0	0,3	0,0
i. Compras (millones de US$)	14,2	14,2	0,0	0,3	0,0
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3 116,2**	**2 675,3**	**2 190,1**	**2 246,0**	**3 178,4**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0145%	0,0145%	0,0144%	0,0143%	0,0135%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) Tasa de interés	5,00%	5,00%	5,00%	5,00%	5,00%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 410,0	1 425,7	1 217,3	1 232,1	484,0
Tasa de interés	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 706,2**	**1 249,6**	**972,8**	**1 013,9**	**2 694,4**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	11 584,7	7 366,7	11 407,0	11 297,5	11 213,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,1	3,9	6,0	6,0	5,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 953,0	3 889,9	3 775,2	3 665,3	3 575,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,1	2,1	2,0	1,9	1,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 180,4	879,8	1 090,8	1 132,8	603,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	4,50 / 4,70 / 4,62	4,55 / 4,65 / 4,61	4,50 / 4,50 / 4,50	4,50 / 4,50 / 4,50	4,50 / 4,50 / 4,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	6,6	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$)	**Abri.22, 2022**	**Abri.25, 2022**	**Abri.26, 2022**	**Abri.27, 2022**	**Abri.28, 2022**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	138,0	-20,3	-60,2	-65,0	-24,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	132,8	354,3	59,4	34,5	-57,4
a. Mercado spot con el público	248,1	132,5	81,0	58,5	-44,1
i. Compras	575,0	566,4	625,1	596,7	543,8
ii. (-) Ventas	327,0	433,9	544,2	538,2	587,9
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-6,6	-5,4	-177,7	-449,5	-114,0
i. Pactadas	88,7	133,8	85,6	298,7	60,2
ii. (-) Vencidas	95,3	139,2	263,4	748,2	174,2
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-30,6	271,5	35,4	-237,1	-43,1
i. Pactadas	488,0	584,8	471,6	678,2	285,3
ii. (-) Vencidas	518,6	313,3	436,2	915,3	328,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	304,1	212,2	346,6	359,3	413,5
ii. A futuro	10,0	80,0	30,0	79,4	113,4
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	308,2	165,5	167,9	147,4	153,3
i. Compras	380,3	286,3	421,0	839,7	291,6
ii. (-) Ventas	72,1	120,8	253,1	692,2	138,3
f. Efecto de Opciones	-0,4	-1,4	0,5	-24,6	0,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-18,6	134,1	76,4	133,2	91,5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,7675	3,8177	3,8163	3,8272	3,8519
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera