# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

**(Millones de Soles)**

| | 30 May 22 | 31 May 22 | 1 Jun 22 | 2 Jun 22 | 3 Jun 22 |
|---|---|---|---|---|---|
| **1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP** | **4 928,7** | **3 088,6** | **5 393,6** | **5 548,1** | **11 029,1** |
| **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 | 6 639,8 | 6 639,8 | 6 639,8 | 6 639,8 | 6 639,8 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Junio del 2022 | 2 010,0 | 2 010,0 | 2 010,0 | 2 010,0 | 2 010,0 |
| Vencimiento de CD BCRP del 6 al 10 de Junio de 2022 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | 500,0 500,0 | 500,0 800,0 | 2000,0 1000,0 800,0 800,0 1400,0 | 1000,0 300,0 500,0 | 300,0 300,0 |
| Propuestas recibidas | 600,0 1500,0 | 1638,0 2300,0 | 4300,0 3650,0 2300,0 800,0 1400,0 | 2400,0 938,0 1350,0 | 900,0 1100,0 |
| Plazo de vencimiento | 1 d 32 d | 1 d 31 d | 1 d 7 d 33 d 7 d 1 d | 1 d 95 d 1 d | 31 d 3 d |
| Tasas de interés: Mínima | 5,61 5,86 | 5,55 5,80 | 5,30 5,70 5,79 5,15 5,0 | 5,10 6,10 5,30 | 5,65 5,32 |
| Máxima | 5,61 5,86 | 6,0 5,87 | 5,65 5,80 5,83 5,45 5,30 | 5,20 6,30 5,35 | 5,75 5,40 |
| Promedio | 5,61 5,86 | 5,77 5,83 | 5,47 5,77 5,81 5,29 5,12 | 5,15 6,22 5,32 | 5,70 5,36 |
| Saldo | 7 762,4 | 8 562,4 | 13 662,4 | 12 062,4 | 10 662,4 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 6 de Junio del 2022 | 500,0 | 900,0 | 3 400,0 | 2 000,0 | 300,0 |
| Vencimiento de Repo Valores del 6 al 10 de Junio de 2022 | 1 400,0 | 1 400,0 | 3 900,0 | 2 000,0 | 2 100,0 |
| 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 Repo de Cartera General | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Vencimiento de Repo de Cartera General del 6 al 10 de Junio 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 | 6 401,7 | 6 401,7 | 6 401,7 | 6 401,7 | 6 401,7 |
| Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Junio del 2022 | 12,6 | 12,6 | 12,6 | 12,6 | 12,6 |
| Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 6 al 10 de Junio de 2022 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 12,6 |
| 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 6 al 10 de Junio de 2022 | | | | | |
| viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP) | | | | | 500,0 |
| Propuestas recibidas | | | | | 815,0 |
| Plazo de vencimiento | | | | | 84 d |
| Márgen: Mínima | | | | | 0,03 |
| Máxima | | | | | 0,03 |
| Promedio | | | | | 0,03 |
| Saldo | 18 134,7 | 18 134,7 | 18 134,7 | 18 134,7 | 17 134,7 |
| Próximo vencimiento de CDV BCRP el 10 de Junio del 2022 | 1 500,0 | 1 500,0 | 1 500,0 | 1 500,0 | 1 999,9 |
| Vencimientos de CDV BCRP del 6 al 10 de Junio de 2022 | 1 500,0 | 1 500,0 | 1 500,0 | 1 500,0 | 1 999,9 |
| 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 6 al 10 de Junio de 2022 | | | | | |
| x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP) | 2 276,3 | 3 191,5 | | | |
| Propuestas recibidas | 2 276,3 | 3 191,5 | | | |
| Plazo de vencimiento | 1 d | 1 d | | | |
| Tasas de interés: Mínima | 3,65 | 3,80 | | | |
| Máxima | 5,00 | 5,00 | | | |
| Promedio | 4,65 | 4,70 | | | |
| Saldo | 4 776,3 | 4 691,5 | 500,0 | 0,0 | 0,0 |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 5 de Junio del 2022 | 3 276,3 | 4 191,5 | 500,0 | 0,0 | 0,0 |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo del 6 al 10 de Junio de 2022 | 4 776,3 | 4 691,5 | 500,0 | 0,0 | 0,0 |
| xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 6 374,0 | 6 374,0 | 6 374,0 | 6 374,0 | 6 374,0 |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 6 de Junio del 2022 | 500,0 | 500,0 | 500,0 | 500,0 | 500,0 |
| Vencimiento de Coloc-TP del 6 al 10 de Junio de 2022 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 500,0 |
| 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 6 al 10 de Junio 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 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Vencimiento de CDR BCRP del 6 al 10 de Junio 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 6 al 10 de Junio de 2022 | | | | | |
| xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular) | 300,0 | 500,0 | 200,0 | 500,0 300,0 | |
| Propuestas recibidas | 680,0 | 707,0 | 481,0 | 745,0 355,0 | |
| Plazo de vencimiento | 7 d | 7 d | 30 d | 7 d 29 d | |
| Tasas de interés: Mínima | 6,35 | 6,61 | 6,80 | 6,21 6,50 | |
| Máxima | 6,65 | 6,70 | 6,80 | 6,55 6,85 | |
| Promedio | 6,36 | 6,66 | 6,80 | 6,38 6,65 | |
| Saldo | 1 677,0 | 2 177,0 | 2 377,0 | 3 177,0 | 3 177,0 |
| Próximo vencimiento de Repo Regular el 6 de Junio del 2022 | 300,0 | 300,0 | 300,0 | 300,0 | 300,0 |
| Vencimiento de REPO del 6 al 10 de Junio de 2022 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 1 300,0 |
| 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 6 al 10 de Junio 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 6 al 10 de Junio 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 6 al 10 de Junio de 2022 | | | | | |
| xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | | 200,0 200,0 Desierta | 200,0 | | 195,0 |
| Propuestas recibidas | | 604,0 550,0 415,0 | 400,0 | | 225,0 |
| Plazo de vencimiento | | 365 d 365 d 273 d | 365 d | | 91 d |
| Tasas de interés: Mínima | | 2,35 2,30 - | 2,28 | | 1,40 |
| Máxima | | 2,35 2,33 - | 2,30 | | 1,55 |
| Promedio | | 2,35 2,31 - | 2,30 | | 1,43 |
| Saldo | 35 323,9 | 35 323,9 | 35 523,9 | 35 523,9 | 35 718,9 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 6 de Junio del 2022 | 400,0 | 720,0 | 720,0 | 720,0 | 720,0 |
| Vencimiento de SC - Venta del 6 al 10 de Junio de 2022 | 400,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 1 060,0 |
| 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 6 al 10 de Junio 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 | 150,0 | | | 150,0 |
| Plazo de vencimiento | 92 d | 183 d | | | 273 d |
| Tasas de interés: Mínima | 5,73 | 5,88 | | | 5,98 |
| Máxima | 5,73 | 5,88 | | | 5,98 |
| Promedio | 5,73 | 5,88 | | | 5,98 |
| Saldo | 10 045,1 | 9 895,1 | 9 695,1 | 9 495,1 | 9 345,1 |
| Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 6 de Junio del 2022 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 |
| Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 6 al 10 de Junio de 2022 | 800,0 | 600,0 | 400,0 | 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 | 0,0 | -137,5 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| i. Compras (millones de US$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tipo de cambio promedio | 0,0000 | 0,0000 | 0,0000 | 0,0000 | 0,0000 |
| ii. Ventas (millones de US$) | 0,0 | 37,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tipo de cambio promedio | 0,0000 | 3,7160 | 0,0000 | 0,0000 | 0,0000 |
| d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$) | 0,4 | 3,3 | 0,4 | 10,4 | 0,0 |
| i. Compras (millones de US$) | 0,4 | 3,3 | 3,7 | 10,4 | 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** | **2 728,7** | **3 358,1** | **11 593,6** | **11 748,1** | **11 129,1** |
| **4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones** | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). | | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0150% | 0,0149% | 0,1480% | 0,1490% | 0,1490% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | | | | | |
| Tasa de interés | 5,50% | 5,50% | 5,50% | 5,50% | 5,50% |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 628,4 | 1 959,8 | 125,3 | 110,7 | 377,2 |
| Tasa de interés | 3,25% | 3,25% | 3,25% | 3,25% | 3,25% |
| **5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones** | **2 100,3** | **1 398,2** | **11 468,3** | **11 637,4** | **10 751,9** |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*) | 11 899,6 | 11 860,9 | 11 744,6 | 18 747,0 | 18 859,7 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 6,2 | 6,1 | 6,1 | 9,8 | 9,8 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 4 450,7 | 4 417,5 | 4 301,2 | 11 468,3 | 11 581,0 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 2,3 | 2,3 | 2,2 | 6,0 | 6,0 |
| **6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP** | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 1 018,3 | 639,5 | 766,4 | 1 004,9 | 1 289,6 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO | 5,00 / 5,30 / 5,29 | 5,20 / 5,40 / 5,35 | 5,20 / 5,30 / 5,25 | 5,00 / 5,30/ 5,00 | 5,00 / 5,00/ 5,00 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 44,0 | 19,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio | | | | 1,00 / 1,00 / 1,00 | 1,00 / 1,00 / 1,00 |
| 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$)** | **May.27, 2022** | **May.30, 2022** | **May.31, 2022** | **Jun.01, 2022** | **Jun.02, 2022** |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g | 41,6 | -1,1 | 24,5 | -66,2 | 32,3 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g | 102,8 | 19,0 | 63,3 | -49,7 | -14,5 |
| a. Mercado spot con el público | 164,9 | 32,3 | 26,1 | -29,0 | -6,1 |
| i. Compras | 467,0 | 316,1 | 754,4 | 269,5 | 258,9 |
| ii. (-) Ventas | 302,1 | 283,8 | 728,3 | 298,5 | 265,0 |
| b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega) | 183,9 | -14,2 | 109,9 | 130,1 | 41,4 |
| i. Pactadas | 275,4 | 32,5 | 312,0 | 295,6 | 379,2 |
| ii. (-) Vencidas | 91,6 | 46,7 | 202,1 | 165,6 | 337,8 |
| c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega) | 118,7 | 5,7 | 153,1 | 187,5 | -5,2 |
| i. Pactadas | 564,4 | 77,4 | 399,5 | 472,2 | 344,7 |
| ii. (-) Vencidas | 445,7 | 71,7 | 246,4 | 284,7 | 349,9 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 426,8 | 77,3 | 279,9 | 480,7 | 330,0 |
| ii. A futuro | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 100,0 | 37,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 351,3 | 19,8 | 50,0 | 100,1 | 10,8 |
| i. Compras | 420,2 | 63,1 | 225,8 | 263,9 | 348,3 |
| ii. (-) Ventas | 69,0 | 43,3 | 175,9 | 163,9 | 337,5 |
| f. Efecto de Opciones | 6,0 | -0,2 | -4,9 | -12,8 | 0,1 |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -191,7 | -8,1 | 40,7 | 52,1 | -7,1 |
| h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,6702 | 3,6749 | 3,7058 | 3,7230 | 3,7112 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera