BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	27 Jun 22	28 Jun 22	30 Jun 22	01 Jul 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**5 886,6**	**4 415,2**	**3 559,5**	**2 988,3**
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)	500,0			
Propuestas recibidas	760,0			
Plazo de vencimiento	30 d			
Tasas de interés: Mínima	5,20			
Máxima	5,27			
Promedio	5,25			
Saldo	7 054,0	7 054,0	7 054,0	7 054,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Julio del 2022	1 630,0	1 630,0	1 630,0	1 630,0
Vencimiento de CD BCRP del 5 al 8 de Julio del 2022	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	400,0	200,0	300,0 700,0	2000,0 2000,0 1200,0 2800,0
Propuestas recibidas	425,0	400,0	952,0 1467,0	5900,0 3900,0 2800,0 2800,0
Plazo de vencimiento	1 d	2 d	92 d 1 d	3 d 3 d 31 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	5,61	6,01	6,76 7,01	6,50 6,30 6,81 5,50
Máxima	5,61	6,01	6,86 7,01	7,15 6,70 6,91 5,70
Promedio	5,61	6,01	6,82 7,01	6,82 6,52 6,85 5,56
Saldo	8 762,4	8 562,4	9 362,4	15 062,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 4 de Julio del 2022	400,0	200,0	2 300,0	8 300,0
Vencimiento de Repo Valores del 5 al 8 de Julio del 2022	2 000,0	1 800,0	2 300,0	0,0
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
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo de Cartera General del 5 al 8 de Julio del 2022	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	6 386,1	6 386,1	6 386,1	6 386,1
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 1 de Agosto del 2022	1,2	1,2	1,2	1,2
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 5 al 8 de Julio del 2022	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
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
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 5 al 8 de Julio del 2022				
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	1000,0	500,0		
Propuestas recibidas	1854,3	800,0		
Plazo de vencimiento	92 d	91 d		
Márgen: Mínima	0,02	0,02		
Máxima	0,02	0,02		
Promedio	0,02	0,02		
Saldo	18 570,0	19 320,0	19 320,0	17 920,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 11 de Julio del 2022	1 400,0	1 400,0	1 400,0	950,0
Vencimientos de CDV BCRP del 5 al 8 de Julio del 2022	1 400,0	1 400,0	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 5 al 8 de Julio del 2022				
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 889,6	3 600,0	3 700,2	
Propuestas recibidas	3 889,6	3 703,5	3 935,2	
Plazo de vencimiento	1 d	2 d	1 d	
Tasas de interés: Mínima	4,80	4,85	3,40	
Máxima	5,50	5,50	5,50	
Promedio	5,25	5,26	5,07	
Saldo	3 889,6	3 600,0	3 700,2	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 3 de Julio del 2022	3 889,6	3 600,0	3 700,2	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 5 al 8 de Julio del 2022	3 889,6	3 600,0	3 700,2	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	6 441,9	6 441,9	6 441,9	6 441,9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 19 de Agosto del 2022	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 5 al 8 de Julio del 2022	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 5 al 8 de Julio del 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	200,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0	200,0
Vencimiento de CDR BCRP del 5 al 8 de Julio del 2022	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 5 al 8 de Julio del 2022				
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	2 577,0	2 077,0	2 077,0	1 877,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 11 de Julio del 2022	500,0	500,0	500,0	200,0
Vencimiento de REPO del 5 al 8 de Julio del 2022	1 000,0	500,0	500,0	0,0
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 5 al 8 de Julio del 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 5 al 8 de Julio del 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 5 al 8 de Julio del 2022				
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	180,0	180,0 200,0 200,0	Desierta 42,0 139,0	300,0 200,0 200,0
Propuestas recibidas	390,0	220,0 403,0 220,0	350,0 135,0 148,0	387,0 490,0 265,0
Plazo de vencimiento	273 d	365 d 365 d 365 d	273 d 365 d 365 d	367 d 367 d 94 d
Tasas de interés: Mínima	2,88	3,17 3,15 3,15	0,00 3,10 3,21	3,00 3,03 2,27
Máxima	2,98	3,25 3,23 3,17	0,00 3,24 3,25	3,15 3,09 2,40
Promedio	2,94	3,19 3,19 3,16	0,00 3,17 3,24	3,03 3,07 2,33
Saldo	35 478,8	35 258,8	34 649,8	35 077,7
Próximo vencimiento de SC-Venta el 5 de Julio del 2022	800,0	790,0	272,1	383,0
Vencimiento de SC - Venta del 5 al 8 de Julio del 2022	1 862,1	1 062,1	272,1	883,0
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
Próximo vencimiento de RED	0,0		0,0	
Vencimiento de RED del 5 al 8 de Julio del 2022	0,0		0,0	0,0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	15,0	50,0		50,0
Propuestas recibidas	65,0	50,0		100,0
Plazo de vencimiento	92 d	183 d		274 d
Tasas de interés: Mínima	6,03	6,13		6,24
Máxima	6,03	6,13		6,30
Promedio	6,03	6,13		6,28
Saldo	6 910,1	6 535,1	5 935,1	5 685,1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 4 de Julio del 2022	425,0	300,0	300,0	450,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 5 al 8 de Julio del 2022	1 325,0	600,0	300,0	300,0
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	0,0	162,0	0,0
i. Compras (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	162,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0000	0,0000	3,8316	0,0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0,0	4,5	3,3	2,7
i. Compras (millones de US$)	0,0	4,5	3,3	2,7
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP				
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP (Valorizado)				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 399,0**	**1 835,2**	**2 050,0**	**1 640,8**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0172%	0,0166%	0,0170%	0,0160%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés				
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 424,3	673,6	719,5	310,3
Tasa de interés	3,50%	3,50%	3,50%	3,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**974,7**	**1 161,6**	**1 330,5**	**10 567,5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	11 981,8	11 840,0	11 728,6	11 513,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,3	6,2	6,1	6,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 721,3	4 579,5	4 468,1	4 265,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,5	2,4	2,3	2,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 246,4	1 030,4	663,6	1 316,4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	5,50 / 5,50 / 5,50	5,50 / 5,55 / 5,50	5,50 / 5,50 / 5,50	5,50 / 5,50 / 5,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	88,0	10,0	0,0	68,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	1,75 / 1,75 / 1,75	1,75 / 1,75 / 1,75	0,00 / 0,00 / 0,00	1,75 / 1,75 / 1,75
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	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$)	**Jun.24, 2022**	**Jun.27, 2022**	**Jun.28, 2022**	**Jun.30, 2022**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	9,3	9,8	-52,7	-30,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-43,4	16,1	14,4	262,6
a. Mercado spot con el público	4,7	10,6	12,9	188,3
i. Compras	405,4	362,6	385,2	777,8
ii. (-) Ventas	400,7	352,1	372,4	589,5
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	8,8	-323,8	38,4	-204,5
i. Pactadas	95,2	261,9	186,8	178,4
ii. (-) Vencidas	86,5	585,8	148,4	382,9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	35,4	-434,7	65,2	-57,2
i. Pactadas	160,2	478,6	255,4	580,7
ii. (-) Vencidas	124,8	913,3	190,2	637,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	520,0	336,2	246,9	649,9
ii. A futuro	15,0	80,0	56,0	58,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	9,2	334,9	43,6	208,3
i. Compras	93,8	911,4	183,3	582,5
ii. (-) Ventas	84,6	576,5	139,7	374,2
f. Efecto de Opciones	-0,5	-19,3	0,3	-0,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	80,7	-99,7	-40,9	-24,5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,7823	3,7847	3,7852	3,8297
(*) Datos preliminares				

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera