# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

**(Millones de Soles)**

| | 25 Jul 22 | 26 Jul 22 | 27 Jul 22 |
|---|---|---|---|
| **1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP** | **5 171,1** | **4 025,0** | **2 485,2** |
| **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 | 6 617,9 | 6 617,9 | 5 117,9 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de Agosto del 2022 | 1 500,0 | 1 500,0 | 1 800,0 |
| Vencimiento de CD BCRP del 28 al 29 de Julio del 2022 | 1 500,0 | 1 500,0 | 0,0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | | | 300,0 1500,0 |
| Propuestas recibidas | | | 900,0 1600,0 |
| Plazo de vencimiento | | | 92 d 5 d |
| Tasas de interés: Mínima | | | 7,37 6,0 |
| Máxima | | | 7,57 6,26 |
| Promedio | | | 7,50 6,22 |
| Saldo | 11 362,4 | 11 058,4 | 11 858,4 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 1 de Agosto del 2022 | 304,0 | 1 000,0 | 3 200,0 |
| Vencimiento de Repo Valores del 28 al 29 de Julio del 2022 | 1 304,0 | 1 000,0 | 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 |
| Próximo vencimiento de Repo de Cartera General | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Vencimiento de Repo de Cartera General del 28 al 29 de Julio del 2022 | 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 | 6 381,6 |
| Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 1 de Agosto del 2022 | 1,2 | 1,2 | 0,6 |
| Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 28 al 29 de Julio del 2022 | 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 |
| 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 |
| 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 28 al 29 de Julio del 2022 | | | |
| viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP) | 800,4 | | |
| Propuestas recibidas | 986,0 | | |
| Plazo de vencimiento | 92 d | | |
| Márgen: Mínima | 0,02 | | |
| Máxima | 0,02 | | |
| Promedio | 0,02 | | |
| Saldo | 20 210,4 | 20 210,4 | 20 210,4 |
| Próximo vencimiento de CDV BCRP el 12 de Agosto del 2022 | 2 280,0 | 2 280,0 | 2 280,0 |
| Vencimientos de CDV BCRP del 28 al 29 de Julio del 2022 | 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 28 al 29 de Julio del 2022 | | | |
| x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP) | 2 600,0 | 2 850,6 | |
| Propuestas recibidas | 3 045,3 | 2 850,6 | |
| Plazo de vencimiento | 1 d | 1 d | |
| Tasas de interés: Mínima | 4,95 | 4,90 | |
| Máxima | 5,31 | 6,00 | |
| Promedio | 5,23 | 5,25 | |
| Saldo | 3 100,0 | 2 850,6 | 0,0 |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 31 de Julio del 2022 | 3 100,0 | 2 850,6 | 0,0 |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo del 28 al 29 de Julio del 2022 | 3 100,0 | 2 850,6 | 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 |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 19 de Agosto del 2022 | 500,0 | 500,0 | 500,0 |
| Vencimiento de Coloc-TP del 28 al 29 de Julio del 2022 | 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 28 al 29 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 | 200,0 | 200,0 | 200,0 |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP el 3 de Octubre del 2022 | 200,0 | 200,0 | 200,0 |
| Vencimiento de CDR BCRP del 28 al 29 de Julio del 2022 | 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 28 al 29 de Julio del 2022 | | | |
| xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular) | | | Desierta |
| Propuestas recibidas | | | 500,0 |
| Plazo de vencimiento | | | 30 d |
| Tasas de interés: Mínima | | | |
| Máxima | | | |
| Promedio | | | |
| Saldo | 2 447,0 | 2 447,0 | 2 247,0 |
| Próximo vencimiento de Repo Regular el 1 de Agosto del 2022 | 200,0 | 200,0 | 300,0 |
| Vencimiento de REPO del 28 al 29 de Julio del 2022 | 200,0 | 200,0 | 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 28 al 29 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 28 al 29 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 28 al 29 de Julio del 2022 | | | |
| xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | 200,0 300,0 100,0 | 300,0 300,0 186,0 | 300,0 300,0 200,0 300,0 |
| Propuestas recibidas | 450,0 795,0 120,0 | 740,0 570,0 236,0 | 790,0 795,0 395,0 790,0 |
| Plazo de vencimiento | 91 d 91 d 91 d | 91 d 91 d 92 d | 91 d 91 d 365 d 91 d |
| Tasas de interés: Mínima | 2,45 2,47 2,54 | 2,50 2,54 2,54 | 2,57 2,50 3,39 2,57 |
| Máxima | 2,60 2,54 2,60 | 2,58 2,60 2,62 | 2,61 2,59 3,52 2,61 |
| Promedio | 2,51 2,49 2,57 | 2,54 2,57 2,57 | 2,59 2,58 3,45 2,59 |
| Saldo | 37 565,1 | 37 061,2 | 36 626,2 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 1 de Agosto del 2022 | 1 289,9 | 1 300,0 | 790,1 |
| Vencimiento de SC - Venta del 28 al 29 de Julio del 2022 | 2 589,9 | 1 300,0 | 0,0 |
| 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 |
| Próximo vencimiento de RED | | 0,0 | 0,0 |
| Vencimiento de RED del 28 al 29 de Julio del 2022 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés | 50,0 | 50,0 | |
| Propuestas recibidas | 190,0 | 150,0 | |
| Plazo de vencimiento | 92 d | 184 d | |
| Tasas de interés: Mínima | 6,56 | 6,64 | |
| Máxima | 6,56 | 6,64 | |
| Promedio | 6,56 | 6,64 | |
| Saldo | 4 000,1 | 4 050,1 | 4 050,1 |
| Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 1 de Agosto del 2022 | 50,0 | 50,0 | 50,0 |
| Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 28 al 29 de Julio del 2022 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| 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 | 0,0 |
| i. Compras (millones de US$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tipo de cambio promedio | 0,0000 | 0,0000 | 0,0000 |
| ii. Ventas (millones de US$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tipo de cambio promedio | 0,0000 | 0,0000 | 0,0000 |
| d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$) | 0,8 | 0,5 | 7,7 |
| i. Compras (millones de US$) | 0,8 | 0,5 | 7,7 |
| ii. Ventas (millones de US$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP | | | |
| i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR | | | |
| ii. Compras de BTP (Valorizado) | | | |
| **3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones** | **2 639,5** | **2 599,7** | **4 285,2** |
| **4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones** | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0167% | 0,0166% | 0,0176% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tasa de interés | | | |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | |
| Tasa de interés | | | |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 1 626,4 | 1 098,0 | 3 200,0 |
| Tasa de interés | 4,00% | 4,00% | 4,00% |
| **5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones** | **1 013,1** | **1 501,7** | **1 085,2** |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*) | 12 820,1 | 12 620,8 | 12 501,7 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 6,6 | 6,4 | 6,4 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 5 404,7 | 5 205,4 | 5 086,3 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 2,8 | 2,7 | 2,6 |
| **6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP** | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 1 439,4 | 1 574,9 | 1 988,3 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO | 5,00 / 6,00 / 6,00 | 6,00 / 6,00 / 6,00 | 6,00 / 6,30 / 6,06 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$) | - | - | 7,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio | - / - / - | - / - / - | 1,75 / 1,75 / 1,75 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV | 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$)** | **Jul.22, 2022** | **Jul.25, 2022** | **Jul.26, 2022** |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g | 7,3 | 24,9 | -78,1 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g | -15,1 | 19,3 | 20,5 |
| a. Mercado spot con el público | 10,2 | 24,6 | 25,4 |
| i. Compras | 447,5 | 376,6 | 455,5 |
| ii. (-) Ventas | 437,3 | 352,0 | 430,1 |
| b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega) | 37,0 | -81,0 | 32,8 |
| i. Pactadas | 144,5 | 320,1 | 177,6 |
| ii. (-) Vencidas | 107,5 | 401,1 | 144,9 |
| c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega) | 15,9 | -181,2 | -1,4 |
| i. Pactadas | 256,1 | 668,9 | 429,1 |
| ii. (-) Vencidas | 240,1 | 850,2 | 430,5 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | |
| i. Al contado | 297,3 | 263,9 | 145,6 |
| ii. A futuro | 20,0 | 68,0 | 32,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 115,6 | 451,5 | 280,8 |
| i. Compras | 218,0 | 834,0 | 422,9 |
| ii. (-) Ventas | 102,4 | 382,5 | 142,1 |
| f. Efecto de Opciones | -0,8 | -1,2 | -5,0 |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -6,1 | -101,2 | -127,9 |
| h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | |
| Tasa de interés | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,9147 | 3,9143 | 3,9186 |
| (*) Datos preliminares | | | |

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera