BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	29 Ago 22	31 Ago 22	01 Set 22	02 Set 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**6 254,7**	**5 961,5**	**4 807,7**	**5 705,1**
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)	200,0	200,0	0,0	
Propuestas recibidas	902,0	794,0	0,0	
Plazo de vencimiento	185 d	183 d	0,0	
Tasas de interés: Mínima	6,78	6,75	0,00	
Máxima	6,80	6,78	0,00	
Promedio	6,79	6,77	0,00	
Saldo	8 369,6	8 669,6	8 669,6	8 669,6
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Setiembre del 2022	2 510,0	2 510,0	2 510,0	2 510,0
Vencimiento de CD BCRP del 5 al 9 de septiembre del 2022	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			2000,0 1000,0 500,0 3000,0	2000,0 300,0 500,0 2000,0
Propuestas recibidas			5290,0 2530,0 1750,0 4954,0	4650,0 630,0 1330,0 4890,0
Plazo de vencimiento			1 d 33 d 7 d 1 d	3 d 91 d 32 d 3 d
Tasas de interés: Mínima			6,50 7,05 6,66 6,52	6,57 7,49 7,07 6,58
Máxima			6,60 7,06 6,66 6,61	6,65 7,56 7,12 6,64
Promedio			6,55 7,05 6,66 6,57	6,61 7,52 7,08 6,61
Saldo	12 458,4	12 558,4	18 408,4	17 708,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 5 de Setiembre del 2022	1 000,0	1 100,0	5 500,0	4 600,0
Vencimiento de Repo Valores del 5 al 9 de septiembre del 2022	1 500,0	1 600,0	5 500,0	5 100,0
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
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General	0,0	0,0	0,0	
Vencimiento de Repo de Cartera General del 5 al 9 de septiembre 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	6 381,1	6 381,1	6 381,1	6 381,1
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 19 de Setiembre del 2022	2,5	2,5	2,5	2,5
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 5 al 9 de septiembre 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 9 de septiembre del 2022				
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Apoyo de Liquidez				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	3,0	3,0	3,0	3,0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez el 17 de Noviembre del 2022	3,0	3,0	3,0	3,0
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 5 al 9 de septiembre del 2022	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	200,0			
Propuestas recibidas	850,0			
Plazo de vencimiento	95 d			
Márgen: Mínima	0,00			
Máxima	0,01			
Promedio	0,00			
Saldo	20 555,0	20 555,0	20 555,0	20 555,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 12 de Setiembre del 2022	1 700,0	1 700,0	1 700,0	1 700,0
Vencimientos de CDV BCRP del 5 al 9 de septiembre del 2022	0,0	0,0	0,0	0,0
x. 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 9 de septiembre del 2022				
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 000,1 3 166,5		3 000,2 2 421,1	
Propuestas recibidas	2 543,5 3 166,5		3 304,0 2 421,1	
Plazo de vencimiento	2 d 2 d		1 d 1 d	
Tasas de interés: Mínima	6,35 6,30		6,40 5,90	
Máxima	6,50 6,50		6,50 6,50	
Promedio	6,46 6,42		6,49 6,33	
Saldo	5 866,6		5 421,3	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	5 866,6		5 421,3	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 5 al 9 de septiembre del 2022	5 866,6		5 421,3	0,0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)			300,0	300,0
Propuestas recibidas			655,1	733,3
Plazo de vencimiento			183 d	182 d
Tasas de interés: Mínima			7,42	7,45
Máxima			7,94	8,10
Promedio			7,68	7,52
Saldo	6 341,8		6 641,8	6 641,8 6 441,7
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 16 de Setiembre del 2022	500,1		500,1	500,1 237,0
Vencimiento de Coloc-TP del 5 al 9 de septiembre del 2022	500,1		500,1	500,1 0,0
xiii. 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 9 de septiembre del 2022				
xiv. 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	200,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 3 de Octubre del 2022	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de CDR BCRP del 5 al 9 de septiembre del 2022	0,0	0,0	0,0	0,0
xv. 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 9 de septiembre del 2022				
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)			300,0	200,0
Propuestas recibidas			477,5	311,0
Plazo de vencimiento			32 d	31 d
Tasas de interés: Mínima			7,00	6,80
Máxima			7,26	7,30
Promedio			7,04	6,89
Saldo	1 747,0	1 747,0	1 747,0	1 647,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 23 de Setiembre del 2022	300,0	300,0	300,0	40,0
Vencimiento de REPO del 5 al 9 de septiembre del 2022	600,0	600,0	300,0	0,0
xvii. 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 9 de septiembre del 2022				
xviii. 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 9 de septiembre del 2022				
xix. 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 9 de septiembre del 2022				
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			200,0 300,0	200,0 300,0 300,0
Propuestas recibidas			400,0 715,0	655,0 840,5 458,0
Plazo de vencimiento			273 d 273 d	273 d 273 d 273 d
Tasas de interés: Mínima			3,74 3,67	3,60 3,59 3,58
Máxima			3,75 3,73	3,72 3,59 3,67
Promedio			3,75 3,72	3,68 3,59 3,61
Saldo	32 826,0	32 826,0	33 136,0	33 741,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 8 de Setiembre del 2022	190,0	190,0	195,0	200,0
Vencimiento de SC - Venta del 5 al 9 de septiembre del 2022	385,0	385,0	195,0	200,0
xxi. 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				
Vencimiento de RED del 5 al 9 de septiembre del 2022		0,0		
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés	30,0			30,0
Propuestas recibidas	90,0			60,0
Plazo de vencimiento	92 d			273 d
Tasas de interés: Mínima	6,72			6,75
Máxima	6,72			6,75
Promedio	6,72			6,75
Saldo	3 840,1	3 790,1	3 740,1	3 770,1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 3 de Setiembre del 2022	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 5 al 9 de septiembre del 2022	100,0	50,0	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	0,0	0,0	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	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0,0	5,3	1,6	3,5
i. Compras (millones de US$)	0,0	5,3	1,6	3 5
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP				
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP (Valorizado)				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**1 958,7**	**2 249,5**	**11 959,6**	**10 982,1**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0137%	0,0145%	0,0143%	0,0125%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés				
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	924,5	734,3	70,0	137,3
Tasa de interés	4,50%	4,50%	4,50%	4,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 034,2**	**1 515,2**	**11 889,6**	**10 844,8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 384,5	12 240,9	12 019,8	19 257,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,2	6,2	6,0	9,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 196,7	5 053,2	4 832,0	11 889,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,6	2,5	2,4	5,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	939,5	1 066,0	1 128,2	1 360,1
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6,40 / 6,50 / 6,47	6,40 / 6,70 / 6,50	6,40 / 6,50 / 6,50	6,40 / 6,50 / 6,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	-	-	-	70,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	- / - / -	- / - / -	- / - / -	2,50 / 2,50 / 2,50
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$)	**Ago.26. 2022**	**Ago.29. 2022**	**Ago.31. 2022**	**Set.01. 2022**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	27,5	-12,4	-60,5	6,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-3,1	180,3	-149,3	45,2
a. Mercado spot con el público	7,6	165,5	-133,1	76,2
i. Compras	495,8	553,8	844,5	561,7
ii. (-) Ventas	488,2	388,4	977,6	485,5
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-95,4	-159,6	212,2	-149,1
i. Pactadas	240,3	226,7	361,0	167,4
ii. (-) Vencidas	305,7	386,4	148,8	316,5
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-94,5	-14,2	121,0	-29,5
i. Pactadas	511,9	344,3	377,0	525,2
ii. (-) Vencidas	606,5	358,5	256,0	554,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	312,5	230,5	289,2	255,4
ii. A futuro	94,0	39,5	80,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	297,9	-9,4	107,2	217,3
i. Compras	592,2	354,4	245,8	532,2
ii. (-) Ventas	294,3	363,8	138,6	314,9
f. Efecto de Opciones	1,5	2,0	-2,4	-2,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-7,8	-53,0	-16,3	72,5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,8427	3,8334	3,8448	3,8657

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera