BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	19 Set 22	20 Set 22	21 Set 22	22 Set 22	23 Set 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**6 811,7**	**5 592,5**	**5 981,8**	**4 659,8**	**2 770,7**
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)	300,0	500,0	200,0		
Propuestas recibidas	1190,0	845,0	740,0		
Plazo de vencimiento	184 d	183 d	365 d		
Tasas de interés: Mínima	6,72	6,70	6,75		
Máxima	6,74	6,91	6,76		
Promedio	6,74	6,77	6,75		
Saldo	9 764,4	9 764,4	10 064,4	10 064,4	10 064,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Octubre del 2022	750,0	1 050,0	1 050,0	1 050,0	1 050,0
Vencimiento de CD BCRP del 26 al 30 de septiembre del 2022	750,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					200,0
Propuestas recibidas					440,0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					7,18
Máxima					7,18
Promedio					7,18
Saldo	13 308,4	13 308,4	13 308,4	13 308,4	13 508,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 26 de Setiembre del 2022	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimiento de Repo Valores del 26 al 30 de septiembre del 2022	0,0	0,0	0,0	0,0	350,0
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 26 al 30 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	6 378,6	6 378,6	6 378,6	6 378,6	6 378,6
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 26 de Diciembre del 2022	9,7	9,7	9,7	9,7	9,7
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 26 al 30 de septiembre del 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 26 al 30 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	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	3,0
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 26 al 30 de septiembre del 2022	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	699,8	499,8	800,0		
Propuestas recibidas	1390,0	865,0	1585,0		
Plazo de vencimiento	93 d	92 d	92 d		
Márgen: Mínima	0,00	0,00	0,00		
Máxima	0,00	0,00	0,00		
Promedio	0,00	0,00	0,00		
Saldo	20 031,3	20 531,1	19 891,1	19 891,1	19 891,1
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 27 de Setiembre del 2022	1 440,0	1 440,0	2 250,0	2 250,0	2 250,0
Vencimientos de CDV BCRP del 26 al 30 de septiembre del 2022	1 440,0	1 440,0	0,0	0,0	2 250,0
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 26 al 30 de septiembre del 2022					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 000,0 1 700,1	1 000,0 1 400,0	1 000,0 1 900,0	1 000,0 1 500,0 1500,0	1 978,0 1 325,8
Propuestas recibidas	1 822,0 2 933,5	3 138,1 2 743,7	3 477,0 3 995,6	3 357,5 2 099,2 2483,8	1 978,0 1 325,8
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 7 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	6,60 6,50	6,65 6,50	6,60 6,30	6,45 6,50 6,35	6,30 6,40
Máxima	6,73 6,70	6,70 6,65	6,66 6,57	6,59 6,75 6,54	6,75 6,74
Promedio	6,70 6,63	6,67 6,59	6,63 6,51	6,53 6,68 6,45	6,57 6,57
Saldo	4 100,1	3 100,0	2 900,0	4 000,0	4 803,8
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 26 de Setiembre del 2022	3 400,1	3 100,0	2 900,0	2 500,0	3 303,8
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 26 al 30 de septiembre del 2022	4 100,1	3 100,0	2 900,0	2 500,0	4 803,8
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 504,7	6 504,7	6 504,7	6 504,7	6 504,7
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 21 de Octubre del 2022	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 26 al 30 de septiembre del 2022	0,0	0,0	0,0	0,0	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 26 al 30 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	200,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 3 de Octubre del 2022	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de CDR BCRP del 26 al 30 de septiembre del 2022	0,0	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 26 al 30 de septiembre del 2022					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 647,0	1 647,0	1 647,0	1 647,0	1 607,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 27 de Setiembre del 2022	40,0	40,0	40,0	40,0	30,0
Vencimiento de REPO del 26 al 30 de septiembre del 2022	40,0	40,0	40,0	40,0	30,0
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 26 al 30 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 26 al 30 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 26 al 30 de septiembre del 2022					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200,0 300,0 300,0				
Propuestas recibidas	804,0 1096,0 745,0				
Plazo de vencimiento	273 d 273 d 273 d				
Tasas de interés: Mínima	3,80 3,57 3,55				
Máxima	3,83 3,69 3,63				
Promedio	3,81 3,59 3,59				
Saldo	34 405,0	35 005,0	35 005,0	35 005,0	35 005,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 28 de Setiembre del 2022	200,0	55,0	55,0	55,0	55,0
Vencimiento de SC - Venta del 26 al 30 de septiembre del 2022	200,0	0,0	0,0	0,0	480,0
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
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 26 al 30 de septiembre del 2022	0,0	0,0			
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés	30,0	30,0			30,0
Propuestas recibidas	60,0	60,0			30,0
Plazo de vencimiento	91 d	181 d			273 d
Tasas de interés: Mínima	6,80	6,79			6,75
Máxima	6,80	6,79			6,75
Promedio	6,80	6,79			6,75
Saldo	3 650,1	3 680,1	3 680,1	3 580,1	3 610,1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 27 de Setiembre del 2022	100,0	100,0	100,0	15,0	15,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 26 al 30 de septiembre del 2022	100,0	100,0	100,0	0,0	115,0
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	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	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0,0	0,0	0,3	0,0	-40,0
i. Compras (millones de US$)	0,0	0,0	0,3	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	40,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 322,1**	**3 432,4**	**3 091,8**	**2 374,9**	**834,7**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0195%	0,0194%	0,0193%	0,0192%	0,0192%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	448,0	121,1	1 125,3	540,0	231,8
Tasa de interés	4,75%	4,75%	4,75%	4,75%	4,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3 874,1**	**3 311,3**	**1 966,5**	**1 834,9**	**602,9**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	14 243,6	14 122,2	13 936,2	13 665,8	13 465,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,1	7,0	6,9	6,8	6,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 883,2	6 761,9	6 570,7	6 300,3	6 100,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,4	3,4	3,3	3,1	3,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	965,3	1 278,6	909,0	973,0	355,4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6,70 / 6,76 / 6,75	6,70 / 6,75 / 6,74	6,50 / 6,75 / 6,75	6,50 / 6,75 / 6,65	6,50 / 6,75 / 6,58
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	30,0	70,0	70,0	-	-
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	2,50 / 2,50 / 2,50	2,50 / 2,50 / 2,50	2,50 / 2,50 / 2,50	- / - / -	- / - / -
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	16,0	16,0			
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	16/6,74				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**Set.16. 2022**	**Set.19. 2022**	**Set.20. 2022**	**Set.21. 2022**	**Set.22. 2022**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	4,1	23,4	2,4	-50,8	138,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	47,5	53,5	95,5	206,7	10,9
a. Mercado spot con el público	50,7	39,0	108,5	208,0	19,1
i. Compras	327,7	501,2	467,4	529,9	437,4
ii. (-) Ventas	277,0	462,2	358,9	321,8	418,2
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-18,7	-403,0	-136,6	-93,3	-22,3
i. Pactadas	115,0	163,0	78,5	155,0	132,9
ii. (-) Vencidas	133,8	566,0	215,2	248,3	155,2
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	25,8	-370,9	99,9	150,5	-150,9
i. Pactadas	254,6	198,6	600,0	432,6	301,7
ii. (-) Vencidas	228,8	569,5	500,1	282,1	452,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	364,6	447,2	614,0	299,3	306,5
ii. A futuro	14,0	29,0	20,0	45,0	64,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	95,8	15,4	276,1	34,8	301,9
i. Compras	212,7	562,6	489,8	280,2	451,9
ii. (-) Ventas	116,9	547,2	213,7	245,4	150,1
f. Efecto de Opciones	1,2	2,0	-13,2	-13,8	-1,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-4,0	2,6	152,4	-2,3	-12,7
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,8783	3,8624	3,8809	3,9003	3,9074
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera