BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	26 Set 22	27 Set 22	28 Set 22	29 Set 22	30 Set 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**3 679,8**	**5 381,2**	**4 771,4**	**5 654,3**	**4 241,5**
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	300.0	300.0	
Propuestas recibidas		640.0	570.0	530.0	
Plazo de vencimiento		181 d	180 d	187 d	
Tasas de interés: Mínima		6.75	6.81	6.83	
Máxima		6.88	6.88	6.88	
Promedio		6.83	6.85	6.85	
Saldo	10 064.4	10 514.4	11 074.4	11 524.4	11 524.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Octubre del 2022	1 050.0	1 050.0	1 050.0	1 050.0	1 050.0
Vencimiento de CD BCRP del 3 al 7 de octubre del 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				100.0	200.0 300.0
Propuestas recibidas				100.0	635.0 350.0
Plazo de vencimiento				1 d	91 d 3 d
Tasas de interés: Mínima				7.25	7.33 6.90
Máxima				7.25	7.34 6.90
Promedio				7.25	7.34 6.90
Saldo	13 458.4	13 458.4	13 458.4	13 558.4	14 258.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 3 de Octubre del 2022	300.0	300.0	300.0	400.0	2 300.0
Vencimiento de Repo Valores del 3 al 7 de octubre del 2022	300.0	300.0	300.0	400.0	4 100.0
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					
Vencimiento de Repo de Cartera General del 3 al 7 de octubre del 2022					
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 3 al 7 de octubre 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 3 al 7 de octubre 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
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 3 al 7 de octubre del 2022		0.0		0.0	0.0
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)		500.0			
Propuestas recibidas		1160.0			
Plazo de vencimiento		92 d			
Márgen: Mínima		0.00			
Máxima		0.00			
Promedio		0.00			
Saldo	19 891.1	18 391.1	18 391.1	18 391.1	18 391.1
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 11 de Octubre del 2022	2 250.0	1 500.0	1 500.0	1 500.0	1 500.0
Vencimientos de CDV BCRP del 3 al 7 de octubre del 2022	2 250.0	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 3 al 7 de octubre del 2022					
xi Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 442.0 1 400.0	1 999.8 1 713.6	1 999.9 1 572.2	3 000.0 328.0 1782.2	2 000.0
Propuestas recibidas	1 442.0 1 893.7	2 384.8 1 713.6	2 101.0 1 572.2	3 051.4 328.0 1782.2	4 122.4
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 7 d 1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	6.50 6.35	6.60 6.55	5.75 6.50	6.60 6.45 6.60	6.65
Máxima	6.75 6.68	6.75 6.75	6.75 6.75	6.75 6.75 6.75	6.74
Promedio	6.69 6.60	6.70 6.65	6.72 6.69	6.74 6.72 6.70	6.72
Saldo	4 342.0	5 213.4	5 072.1	5 110.2	2 328.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 3 de Octubre del 2022	2 842.0	3 713.4	5 072.1	4 782.2	2 000.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 3 al 7 de octubre del 2022	4 342.0	5 213.4	5 072.1	4 782.2	2 328.0
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 3 al 7 de octubre 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 3 al 7 de octubre 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 3 al 7 de octubre del 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	200.0
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 3 al 7 de octubre del 2022					
xvi Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 607.0	1 577.0	1 577.0	1 577.0	1 577.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de Octubre del 2022	30.0	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de REPO del 3 al 7 de octubre del 2022	30.0	0.0	0.0	0.0	500.0
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 3 al 7 de octubre 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 3 al 7 de octubre 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 3 al 7 de octubre del 2022					
xx Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300.0 200.0 300.0 24.0	300.0 300.0 270.0	300.0 200.0	200.0 40.0 200.0 300.0	200.0 300.0 300.0 129.0
Propuestas recibidas	930.0 460.0 525.0 108.0	905.0 695.0 320.0	419.0 252.0	396.0 106.0 455.0 450.0	370.0 720.0 525.0 129.0
Plazo de vencimiento	273 d 273 d 273 d 274 d	273 d 273 d 273 d	181 d 273 d	91 d 274 d 274 d 274 d	181 d 181 d 181 d 181 d
Tasas de interés: Mínima	3.67 3.77 3.69 3.88	3.77 3.67 3.75	3.45 3.89	2.69 4.00 3.84 3.80	3.89 3.82 3.69 3.89
Máxima	3.87 3.91 3.97 3.95	3.85 3.82 4.04	3.50 4.04	3.44 4.20 3.96 4.03	3.90 3.89 3.80 4.05
Promedio	3.77 3.86 3.88 3.89	3.80 3.76 3.88	3.48 3.96	3.22 4.06 3.85 3.94	3.90 3.86 3.79 3.95
Saldo	35 829.0	36 699.0	37 144.0	37 484.0	38 388.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 3 de Octubre del 2022	55.0	55.0	400.0	25.0	280.0
Vencimiento de SC - Venta del 3 al 7 de octubre del 2022	480.0	480.0	425.0	25.0	2 879.9
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	0.0
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 3 al 7 de octubre del 2022					
xxii Subasta de Swap de Tasas de Interés	30.0	30.0			30.0
Propuestas recibidas	60.0	60.0			75.0
Plazo de vencimiento	91 d	181 d			273 d
Tasas de interés: Mínima	6.83	6.83			6.82
Máxima	6.83	6.83			6.82
Promedio	6.83	6.83			6.82
Saldo	3 640.1	3 655.1	3 655.1	3 555.1	3 585.1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 4 de Octubre del 2022	15.0	100.0	100.0	50.0	50.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 3 al 7 de octubre del 2022	115.0	100.0	100.0	0.0	200.0
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	4.0	0.0	39.9	355.0
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	1.0	0.0	10.0	89.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	3.9650	0.0000	3.9870	3.9889
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.2	4.0	1.7	0.4	1.5
i. Compras (millones de US$)	0.2	4.0	1.7	0.4	1.5
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**1 621,8**	**1 910,3**	**1 950,4**	**1 814,4**	**3 642,5**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0191%	0.0191%	0.0190%	0.0189%	0.0189%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	522.0	611.8	724.9	769.0	1 793.3
Tasa de interés	4.75%	4.75%	4.75%	4.75%	4.75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 099,8**	**1 298,5**	**1 225,5**	**1 045,4**	**1 849,2**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 784.2	12 642.6	12 507.8	12 370.2	12 232.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.4	6.3	6.2	6.2	6.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 418.7	5 277.2	5 142.2	5 004.6	4 866.6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.7	2.6	2.6	2.5	2.4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 099.2	923.2	345.0	1 250.0	1 505.9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6.60 / 6.75 / 6.75	6.50 / 6.75 / 6.75	6.75 / 6.75 / 6.75	6.75 / 6.75 / 6.75	6.00 / 6.90 / 6.81
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	106.0	103.0	103.5	73.5	108.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	3.25 / 3.25 / 3.25	3.25 / 3.25 / 3.25	3.25 / 3.25 / 3.25	3.25 / 3.25 / 3.25	3.25 / 3.25 / 3.25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
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$)	Set.23. 2022	Set.26. 2022	Set.27. 2022	Set.28. 2022	Set.29. 2022
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-112.5	-34.6	158.4	-116.1	-33.1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	60.7	27.7	175.1	1.8	69.7
a. Mercado spot con el público	121.0	-3.2	177.0	-10.9	59.7
i. Compras	589.1	313.0	634.2	451.2	818.1
ii. (-) Ventas	468.2	316.2	457.2	462.1	758.4
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	65,5	-119,7	-275,6	-116,1	-72,8
i. Pactadas	124.6	68.4	98.3	187.8	195.7
ii. (-) Vencidas	59.1	188.1	373.9	303.9	268.6
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	238.7	145.0	-40.8	116.2	103.4
i. Pactadas	357.5	435.9	351.8	580.8	390.6
ii. (-) Vencidas	118.8	290.9	392.6	464.5	287.3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	265.4	265.7	589.6	421.9	413.5
ii. A futuro	77.0	42.0	108.0	52.0	159.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	31.8	141,1	23,2	173,5	18,1
i. Compras	80.2	287.8	388.8	449.0	286.1
ii. (-) Ventas	48.5	146.8	365.6	275.5	268.0
f. Efecto de Opciones	0,0	-6,7	-2,3	1,8	-12,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-32.3	201.8	214.1	112.5	96.1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.9099	3.9396	3.9471	3.9491	3.9724
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera