BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	03 Oct 22	04 Oct 22	05 Oct 22	06 Oct 22	07 Oct 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**3 176,2**	**3 518,9**	**4 512,1**	**5 391,0**	**5 262,7**
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)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 524,4	11 524,4	11 524,4	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 10 al 14 de octubre del 2022	0,0	0,0	0,0	0,0	1 050,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	3000,0 2000,0 1000,0 500,0 2300,0	5000,0 1000,0 2060,5	3000,0 300,0 500,0 4400,1	4000,1 1000,0 1900,0	4000,0 1000,0 200,0 1200,0
Propuestas recibidas	7450,0 4600,0 1500,0 835,0 2800,0	6650,0 2600,0 3880,0	3600,0 300,0 1100,0 5700,0	8100,0 3900,0 5450,0	5900,0 1800,0 600,0 2120,0
Plazo de vencimiento	1 d 1 d 31 d 7 d 1 d	1 d 31 d 1 d	1 d 1 d 7 d 1 d	1 d 1 d 1 d	3 d 3 d 94 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	6,79 6,87 7,25 6,77 6,75	6,75 7,39 6,75	6,75 6,75 6,85 6,75	6,75 6,80 6,82	7,0 7,0 7,62 7,01
Máxima	6,83 6,90 7,65 6,84 6,84	6,85 7,46 6,85	6,78 6,75 6,88 6,85	6,80 6,80 6,91	7,11 7,05 7,81 7,05
Promedio	6,81 6,88 7,43 6,80 6,76	6,79 7,44 6,79	6,76 6,75 6,87 6,79	6,77 6,80 6,86	7,05 7,03 7,70 7,03
Saldo	20 758,4	20 018,9	20 858,5	20 058,5	19 558,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 10 de Octubre del 2022	8 800,0	7 360,5	7 700,1	6 900,1	7 500,0
Vencimiento de Repo Valores del 10 al 14 de octubre del 2022	9 100,0	7 360,5	7 700,1	6 900,1	8 600,0
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		0,0			0,0
Vencimiento de Repo de Cartera General del 10 al 14 de octubre del 2022		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
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 10 al 14 de octubre 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	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 10 al 14 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	3,0	3,0
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 10 al 14 de octubre del 2022	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	0,0				
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Márgen: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	18 391,1	18 391,1	18 391,1	18 391,1	18 391,1
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 11 de Octubre del 2022		1 500,0	1 500,0	1 500,0	1 500,0
Vencimientos de CDV BCRP del 10 al 14 de octubre del 2022		0,0	0,0	0,0	3 500,0
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 10 al 14 de octubre del 2022					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	328,0	328,0	328,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	328,0	328,0	328,0		0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 10 al 14 de octubre del 2022	328,0	328,0	328,0		0,0
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
Vencimiento de Coloc-TP del 10 al 14 de octubre del 2022		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 10 al 14 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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP					0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 10 al 14 de octubre del 2022					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 10 al 14 de octubre del 2022					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	700,0		200,0		300,0
Propuestas recibidas	1089,0		351,0		755,0
Plazo de vencimiento	31 d		7 d		31 d
Tasas de interés: Mínima	7,15		7,00		7,31
Máxima	7,90		7,20		7,46
Promedio	7,30		7,13		7,32
Saldo	1 777,0	1 777,0	1 977,0	1 977,0	2 277,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 12 de Octubre del 2022		30,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO del 10 al 14 de octubre del 2022		0,0	0,0	0,0	230,0
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 10 al 14 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 10 al 14 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 10 al 14 de octubre del 2022					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200,0 200,0		240,0 200,0	300,0 300,0	300,0
Propuestas recibidas	204,0 233,0		455,0 389,0	625,0 460,0	460,0
Plazo de vencimiento	92 d 182 d		182 d 181 d	180 d 180 d	185 d
Tasas de interés: Mínima	3,34 3,65		3,95 3,85	3,95 3,94	3,98
Máxima	3,60 4,05		4,05 3,97	4,04 4,05	4,05
Promedio	3,48 3,94		4,03 3,91	3,99 3,97	4,01
Saldo	38 508,0	38 508,0	38 248,0	37 948,0	37 248,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 de Octubre del 2022	700,0	700,0	900,0	999,9	500,0
Vencimiento de SC - Venta del 10 al 14 de octubre del 2022	2 599,9	2 599,9	1 899,9	999,9	650,0
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 10 al 14 de octubre del 2022					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés	30,0	30,0			30,0
Propuestas recibidas	90,0	90,0			50,0
Plazo de vencimiento	92 d	182 d			273 d
Tasas de interés: Mínima	6,84	6,83			6,75
Máxima	6,84	6,83			6,75
Promedio	6,84	6,83			6,75
Saldo	3 615,1	3 595,1	3 495,1	3 495,1	3 475,1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 11 de Octubre del 2022	50,0	100,0	50,0	50,0	50,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 10 al 14 de octubre del 2022	200,0	150,0	50,0	50,0	175,0
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$)	1,9	0,2	0,2	0,0	1,3
i. Compras (millones de US$)	1,9	0,2	0,2	0,0	1,3
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**12 659,2**	**11 579,9**	**12 912,1**	**12 291,0**	**11 961,7**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0190%	0,0190%	0,0190%	0,0189%	0,0198%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) Tasa de interés	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,0	112,0	96,0	89,0	164,0
Tasa de interés	4,75%	4,75%	4,75%	4,75%	5,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**12 657,2**	**11 467,9**	**12 816,1**	**12 202,0**	**11 797,7**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	11 982,3	14 371,9	14 977,0	16 028,0	16 410,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,0	7,1	7,4	7,9	8,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 616,7	7 253,2	7 858,3	8 909,3	9 291,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,3	3,6	3,9	4,4	4,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	517,4	807,3	1 001,9	1 330,5	1 355,4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6,75 / 6,90 / 6,82	6,75 / 6,80 / 6,75	6,75 / 6,90 / 6,76	6,75 / 7,15 / 6,90	7,00 / 7,40 / 7,13
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	-	18,0	18,0	10,0	9,9
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
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.30. 2022**	**Oct.03 2022**	**Oct.04 2022**	**Oct.05 2022**	**Oct.06 2022**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	22,4	9,2	22,2	-22,8	-15,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	116,8	-96,7	19,3	103,0	-5,0
a. Mercado spot con el público	-6,1	-8,1	23,4	99,2	6,1
i. Compras	606,9	403,7	376,2	323,1	439,4
ii. (-) Ventas	613,0	411,8	352,8	223,9	433,4
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	100,8	16,2	145,6	-17,7	4,4
i. Pactadas	175,4	145,8	205,2	155,7	242,2
ii. (-) Vencidas	74,6	129,5	59,5	173,4	237,7
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	421,5	-58,6	148,8	37,2	-68,6
i. Pactadas	541,2	164,1	413,2	389,4	673,5
ii. (-) Vencidas	119,6	222,7	264,4	352,3	742,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	280,9	356,8	368,2	390,5	400,5
ii. A futuro	60,0	40,0	20,0	30,0	5,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	79,0	58,5	202,0	185,0	495,6
i. Compras	115,3	185,2	261,5	349,0	732,7
ii. (-) Ventas	36,3	126,7	59,5	164,0	237,1
f. Efecto de Opciones	-0,6	2,0	6,1	-2,2	-4,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	315,8	-25,0	-1,2	-71,1	-82,0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,9848	3,9640	3,9516	3,9648	3,9831

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera