BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	30 Ene 23	31 Ene 23	01 Feb 23	02 Feb 23	03 Feb 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**6 694,4**	**5 601,3**	**5 164,6**	**10 985,1**	**9 697,6**
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)		-10,0			
Propuestas recibidas		294,0			
Plazo de vencimiento		92 d			
Tasa de interés: Mínima		7,74			
Máxima		7,74			
Promedio		7,74			
Saldo	13 196,5	13 196,5	13 196,5	13 196,5	13 196,5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 20 de Febrero del 2023	1 550,4	1 550,4	1 550,4	1 550,4	
Vencimiento de CD BCRP del 6 al 10 de febrero de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			2000,0 500,0 1000,0 500,0	1000,0 1000,0 500,0	1000,0 1000,0 500,0 800,0
Propuestas recibidas			6665,0 9030,0 3360,0 1050,0	3625,0 3025,0 1500,0	3575,0 2500,0 1330,0 2130,0
Plazo de vencimiento			1 d 7 d 1 d 7 d	1 d 1 d 1 d	3 d 3 d 91 d 3 d
Tasa de interés: Mínima			7,91 7,92 7,91 7,90	7,93 7,95 7,98	7,95 7,96 8,75 7,95
Máxima			8,05 7,95 7,96 7,93	7,97 7,97 7,99	8,0 8,02 8,87 7,98
Promedio			7,98 7,94 7,94 7,91	7,95 7,96 7,99	7,96 7,99 8,81 7,97
Saldo	9 348,4	9 348,4	13 348,4	10 848,4	13 148,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 6 de Febrero del 2023	500,0	500,0	3 000,0	3 000,0	3 800,0
Vencimiento de Repo Valores del 6 al 10 de febrero de 2023	500,0	500,0	3 500,0	3 000,0	4 800,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa 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 6 al 10 de febrero de 2023					
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 341,7	6 341,7	6 341,7	6 341,7	6 341,7
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Marzo del 2023	1,2	1,2	1,2		1,2
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 6 al 10 de febrero de 2023	0,0	0,0	0,0		0,0
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)					
Garantía para los créditos					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo adjudicado	53 399,9	53 399,9	53 399,9	53 399,9	53 399,9
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)					
Garantía para los créditos					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo adjudicado	1 882,2	1 882,2	1 882,2	1 882,2	1 882,2
vi. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO Especial - CDR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR					
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 6 al 10 de febrero de 2023					
vii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Apoyo de Liquidez					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez					
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 6 al 10 de febrero de 2023					
b. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)		-300,0			
Propuestas recibidas		580,0			
Plazo de vencimiento		92 d			
Margen: Mínima		-0,09			
Máxima		-0,09			
Promedio		-0,09			
Saldo	14 995,3	14 695,3	15 415,3	15 415,3	15 415,3
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 17 de Febrero del 2023	1 509,8	1 509,8	1 509,8		1 509,8
Vencimientos de CDV BCRP del 6 al 10 de febrero de 2023	0,0	0,0	0,0		0,0
c. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP					
Vencimiento de CDLD BCRP del 6 al 10 de febrero de 2023					
d. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 305,8	6 740,1			
Propuestas recibidas	3 905,8	6 740,1			
Plazo de vencimiento	1 d	1 d			
Tasa de interés: Mínima	7,50	7,50			
Máxima	7,75	7,75			
Promedio	7,73	7,73			
Saldo	3 305,8	6 740,1	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	3 305,8	6 740,1			
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 6 al 10 de febrero de 2023	3 305,8	6 740,1			
e. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300,0				
Propuestas recibidas	545,4				
Plazo de vencimiento	178 d				
Tasa de interés: Mínima	8,40				
Máxima	8,88				
Promedio	8,70				
Saldo	6 795,8	6 795,8	6 795,8	6 795,8	6 795,8
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de Febrero del 2023	300,0	300,0	300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 6 al 10 de febrero de 2023	0,0	0,0	0,0		0,0
f. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN del 6 al 10 de febrero de 2023					
g. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP					
Vencimiento de CDR BCRP del 6 al 10 de febrero de 2023					
h. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 6 al 10 de febrero de 2023					
xxi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	792,0	792,0	792,0	792,0	792,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 24 de Marzo del 2023	200,0	200,0	200,0		200,0
Vencimiento de REPO del 6 al 10 de febrero de 2023	0,0	0,0	0,0		0,0
xxii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de recompra					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso					
Vencimiento de REPO del 6 al 10 de febrero de 2023					
xxiii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 6 al 10 de febrero de 2023					
xxiv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 6 al 10 de febrero de 2023					
xxv. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200,0 200,0	200,0 60,0 55,0	200,0		200,0 110,0
Propuestas recibidas	340,0 560,0	440,0 50,0 55,0	500,0		310,0 150,0
Plazo de vencimiento	273 d 182 d	181 d 181 d 181 d	181 d		182 d 182 d
Tasa de interés: Mínima	5,45 5,17	5,25 5,50 5,34	5,40		5,40 5,46
Máxima	5,48 5,17	5,45 5,50 5,45	5,50		5,49 5,50
Promedio	5,46 5,17	5,40 5,50 5,35	5,47		5,46 5,49
Saldo	26 912,2	26 929,2	26 699,2	26 699,2	26 239,2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 7 de Febrero del 2023	625,0	200,0	680,0		200,0
Vencimiento de SC - Venta del 6 al 10 de febrero de 2023	1 500,0	880,0	680,0		400,0
xxvi. Subasta de Repo de Valores para proveer Aliaga (REAL)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de REO					
Vencimiento de REO del 6 al 10 de febrero de 2023					
xxvii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasa de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 730,0	1 700,0	1 700,0	1 650,0	1 650,0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 6 de Febrero del 2023	30,0	50,0	50,0		50,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 6 al 10 de febrero de 2023	80,0	50,0	50,0		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	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$)	0,0	2,2	0,8	0,0	0,0
i. Compras (millones de US$)	0,0	2,2	0,8	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Compras en Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valoriza)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3 686,4**	**2 319,3**	**13 164,6**	**13 085,1**	**12 997,6**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0221%	0,0221%	0,0222%	0,0222%	0,0221%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 799,0	1 299,7	299,0	0,0	616,0
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 886,5**	**1 019,6**	**12 914,6**	**13 085,1**	**12 381,6**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 124,6	12 061,7	11 921,1	20 290,1	20 347,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,1	6,1	6,0	10,0	10,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 902,0	4 835,4	4 692,2	12 914,6	13 038,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,5	2,4	2,4	6,4	6,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	903,6	726,9	692,5	1 091,1	1 837,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7,75 / 7,80 / 7,75	6,20 / 7,80 / 7,73	7,75 / 7,80 / 7,77	7,75 / 8,00 / 7,75	7,75 / 7,90 / 7,83
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	19,0	- / - / -	19,0	4,75 / 4,75 / 4,75	22,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	4,70 / 4,75 / 4,70		4,50 / 4,75 / 4,62	4,75 / 4,75 / 4,75	4,75 / 4,80 / 4,78
c. Total mercado secundario de COBCRP, COBCRP-NR y CDV					
Plazo hasta 1 mes o menos (monto / tasa promedio)					
Plazo hasta 3 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo hasta 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo hasta 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**Ene.27 2023**	**Ene.30 2023**	**Ene.31 2023**	**Feb.01 2023**	**Feb.02 2023**
Flujo de la posición global = a + b.1 - c.1 + e + f + g	-75,7	79,0	-13,4	-80,4	32,7
Flujo de la posición contable = a + b.1 - c.1 + e + g	-115,1	139,9	-30,4	-168,5	-22,5
a. Mercado spot con el público	-115,5	384,4	-26,4	198,9	-18,3
i. Compras	360,4	779,1	563,4	513,5	973,6
ii. (-) Ventas	476,0	394,6	589,8	680,3	992,0
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	98,0	298,1	98,7	9,6	-139,9
i. Pactadas	345,5	262,8	171,0	274,3	359,2
ii. (-) Vencidas	433,6	66,6	114,4	222,8	495,0
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	-28,3	326,7	-34,8	-96,3	-299,9
i. Pactadas	628,0	500,6	245,8	115,1	345,0
ii. (-) Vencidas	656,3	173,9	280,6	211,4	536,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	499,2	535,6	268,6	408,8	1101,7
ii. A futuro	40,0	119,2	0,0	40,0	36,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	295,3	92,4	182,5	9,6	85,9
i. Compras	683,7	113,6	278,1	202,0	526,0
ii. (-) Ventas	427,4	51,2	112,6	211,6	479,1
f. Efecto de Opciones	3,4	2,9	0,1	0,0	1,6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	64,6	28,5	28,5	3,1	3,2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,8231	3,8518	3,8497	3,8461	3,8294

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera