BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	15 May 23	16 May 23	17 May 23	18 May 23	19 May 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**6 915.5**	**6 949.9**	**5 542.2**	**4 362.7**	**2 359.4**
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)	399.9	1200.0 600.0	800.0	500.0	
Procuestas recibidas	1165.0	2020.0 1299.0	1981.0	1293.0	
Plazo de vencimiento	182 d	184 d 92 d	184 d	183 d	
Tasas de interés: Mínima	7.48	7.47 7.45	7.45	7.45	
Máxima	7.54	7.52 7.55	7.50	7.50	
Promedio	7.52	7.50 7.52	7.49	7.49	
Saldo	23 126.9	25 426.9	25 991.9	26 041.9	26 041.9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 25 de Mayo del 2023	100.0	580.0	450.0	300.0	300.0
Vencimiento de CD BCRP del 22 al 26 de mayo de 2023	1 110.0	1 010.0	450.0	0.0	300.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					580.0
Procuestas recibidas					1400.0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					8.08
Máxima					8.26
Promedio					8.18
Saldo	13 958.4	13 958.4	13 958.4	13 958.4	13 958.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 25 de Mayo del 2023	900.0	900.0	900.0	900.0	900.0
Vencimiento de Reso Valores del 22 al 26 de mayo de 2023	900.0	900.0	900.0	900.0	500.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco de Cartera General					
Vencimiento de Reso de Cartera General del 22 al 26 de mayo de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 332.2	6 332.2	6 332.2	6 332.2	6 332.2
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo	3.7	3.7	3.7	3.7	3.7
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativo del 22 al 26 de mayo de 2023	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					
Procuestas 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					
Procuestas 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)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR					
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 22 al 26 de mayo de 2023					
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acceso de Liquidez					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco de Cartera para el Acceso de Liquidez					
Vencimientos de Reso de Cartera para el Acceso de Liquidez del 22 al 26 de mayo de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 152.6	4 936.3	4 936.3	4 936.3	4 186.3
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 23 de Mayo del 2023	1 216.3	750.0	750.0	750.0	1 482.3
Vencimientos de CDV BCRP del 22 al 26 de mayo de 2023	1 966.3	750.0	750.0	750.0	1 932.3
x. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP					
Vencimiento de CDLD BCRP del 22 al 26 de mayo de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	500.0	900.0	500.0 1 253.0	499.9 1 700.0	500.0 1 400.0
Procuestas recibidas	1 196.7	2 668.8	1 866.7 1 253.0	1 966.7 1 999.0	1 791.7 1 548.0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	6.77	6.90	6.90 7.00	7.10 7.11	7.10 7.14
Máxima	7.40	7.10	7.50 7.70	7.50 7.75	7.45 7.75
Promedio	7.07	7.00	7.11 7.26	7.38 7.51	7.31 7.53
Saldo	300.0	900.0	1 753.0	2 199.9	1 900.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 22 de Mayo del 2023	300.0	900.0	1 753.0	2 199.9	1 900.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 22 al 26 de mayo de 2023	300.0	900.0	1 753.0	2 199.9	1 900.0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	232.7	200.0		300.0	
Procuestas recibidas	427.7	246.8		375.8	
Plazo de vencimiento	182 d	184 d		183 d	
Tasas de interés: Mínima	8.08	8.02		7.91	
Máxima	8.48	8.32		8.15	
Promedio	8.08	8.21		8.02	
Saldo	6 766.9	6 766.9	6 766.9	6 766.9	6 766.9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 22 de Mayo del 2023	200.0	300.0	300.0	104.4	104.4
Vencimiento de Coloc-TP del 22 al 26 de mayo de 2023	500.0	300.0	300.0	0.0	104.4
xiii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN del 22 al 26 de mayo de 2023					
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	60.0	60.0	60.0	60.0	60.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	60.0	60.0	60.0	60.0	60.0
Vencimiento de CDR BCRP del 22 al 26 de mayo de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 22 al 26 de mayo de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 282.0	1 282.0	1 255.0	1 197.0	1 197.0
Próximo vencimiento de Reco Regular el 8 de Junio del 2023	27.0	27.0	58.0	300.0	300.0
Vencimiento de REPO del 22 al 26 de mayo de 2023	85.0	85.0	58.0	0.0	0.0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco					
Vencimiento de REPO del 22 al 26 de mayo de 2023					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 22 al 26 de mayo de 2023					
xix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 22 al 26 de mayo de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0	200.0 200.0	200.0 300.0	300.0	
Procuestas recibidas	770.0	1000.0 895.0	940.0 865.0	1045.0	
Plazo de vencimiento	184 d	276 d 276 d	184 d 184 d	183 d	
Tasas de interés: Mínima	5.60	5.55 5.27	5.45 5.47	5.49	
Máxima	5.60	5.57 5.34	5.59 5.65	5.59	
Promedio	5.60	5.56 5.30	5.53 5.55	5.54	
Saldo	34 071.2	34 271.2	34 521.2	34 621.2	34 621.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 23 de Mayo del 2023	200.0	250.0	200.0	345.0	345.0
Vencimiento de SC - Venta del 22 al 26 de mayo de 2023	650.0	450.0	200.0	0.0	845.0
xxi. Subasta de Reco de Valores para arrowar dólares (RED)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 22 al 26 de mayo de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	495.0	495.0	495.0	495.0	465.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 22 de Mayo del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	15.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 22 al 26 de mayo de 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	45.0
b. Liquid. Reros 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$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a
ii. Ventas (millones de US$)	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	-31.7	12.4	0.0	1.6	0.4
i. Compras (millones de US$)	1.1	12.4	0.0	1.6	0.4
ii. Ventas (millones de US$)	32.8	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	90.0	0.0	98.3	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**6 116.6**	**4 911.4**	**3 580.2**	**2 070.3**	**1 924.6**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	646.6	1 320.0	589.0	395.0	178.0
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**5 472.0**	**3 591.4**	**2 991.2**	**2 475.8**	**1 746.6**
e. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	16 169.1	16 169.1	15 489.5	15 179.8	14 880.0
f. Fondo de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOMN) (*)	7.9	7.9	7.6	7.4	7.3
g. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 644.8	8 644.8	7 966.1	7 956.8	7 956.8
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOMN) (*)	4.2	4.2	3.9	3.9	3.9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 427.5	1 594.0	1 215.1	759.9	767.8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	128.0	133.0	80.0	130.0	129.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo hasta 1 mes o menos (monto / tasa promedio)					
Plazo hasta 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo hasta 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo hasta 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**May.12 2023**	**May.15 2023**	**May.16 2023**	**May.17 2023**	**May.18 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-49.8	-24.9	3.6	-30.4	91.7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	60.9	33.4	-47.6	65.8	-22.4
a. Mercado spot con el público	72.2	69.6	-43.3	76.8	-6.6
i. Compras	397.3	582.1	512.8	525.4	430.1
ii. (-) Ventas	325.1	482.4	556.1	448.6	436.7
b. Compras forward y swap al público (con v sin entrega)	-23.9	-193.0	165.1	43.7	-234.8
i. Pactadas	29.5	373.2	366.5	191.6	304.9
ii. (-) Vencidas	53.4	566.2	201.4	147.9	539.5
c. Ventas forward v swap al público (con y sin entrega)	56.2	-131.8	169.8	215.4	-319.7
i. Pactadas	387.1	510.1	500.2	399.7	787.4
ii. (-) Vencidas	330.9	641.9	330.3	184.3	1107.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	252.2	201.5	570.1	612.5	668.6
ii. A futuro	5.0	58.0	80.0	43.0	0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	273.6	14.1	120.6	28.2	557.6
i. Compras	326.4	540.7	321.6	175.5	1096.2
ii. (-) Ventas	52.8	526.6	201.0	147.3	538.5
f. Efecto de Opciones	-0.1	0.3	-0.9	0.3	0.2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-37.9	-2.0	60.8	67.3	23.0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6614	3.6640	3.6831	3.6954	3.7030
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera