BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	24 Jul 23	25 Jul 23	26 Jul 23	27 Jul 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**5 799,5**	**5 629,0**	**5 765,9**	**3 896,0**
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			
Propuestas recibidas	518.0			
Plazo de vencimiento	182 d			
Tasas de interés: Mínima	7.50			
Máxima	7.50			
Promedio	7.50			
Saldo	10 680.0	10 680.0	10 680.0	10 680.0
Próximo vencimiento de CD BCRP al 14 de Agosto del 2023	911.0	911.0	911.0	911.0
Vencimiento de CD BCRP al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				600.0
Propuestas recibidas				1382.0
Plazo de vencimiento				92 d
Tasas de interés: Mínima				8.26
Máxima				8.38
Promedio				8.29
Saldo	14 903.4	14 903.4	14 903.4	15 503.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores al 31 de Julio del 2023	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de Repo Valores al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023	0.0	0.0	0.0	2 250.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General				
Vencimiento de Repo de Cartera General al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023				
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	6 305.8	6 305.8	6 303.4	6 303.4
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 31 de Agosto del 2023	2.5	2.5	1.7	1.7
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023	2.5	2.5	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
vi. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Excepcial)				
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
vii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO Excecial - CDR)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de REPO Excecial - CDR				
Vencimiento de Repo Excecial - CDR al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023				
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Aporvo de Liquidez				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Aporvo de Liquidez				
Vencimientos de Repo de Cartera para el Aporvo de Liquidez al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023				
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Mínimo: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de CDV BCRP				
Vencimientos de CDV BCRP al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023				
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 al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023				
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 999.9 2 229.5	2 000.0 2 001.6	2 000.1 1 802.5	2 000.0 2 213.0
Propuestas recibidas	2 222.0 2 229.5	2 603.8 2 001.6	2 718.4 1 802.5	2 083.5 2 213.0
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	4 d 4 d
Tasas de interés: Mínima	7.69 7.65	7.70 7.70	7.65 7.60	7.62 7.70
Máxima	7.75 7.75	7.75 7.75	7.75 7.75	7.75 7.75
Promedio	7.73 7.73	7.74 7.73	7.74 7.71	7.73 7.73
Saldo	4 229.4	4 001.6	3 802.6	4 213.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 27 de Julio del 2023	4 229.4	4 001.6	3 802.6	4 213.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023	4 229.4	4 001.6	3 802.6	4 213.0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	7 044.3	7 044.3	7 044.3	6 744.3
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Julio del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023	300.0	300.0	300.0	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 al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023				
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de CDR BCRP				
Vencimiento de CDR BCRP al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023				
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 al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023				
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	2 257.1	2 257.1	2 257.1	2 257.1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 2 de Agosto del 2023	60.0	60.0	60.0	60.0
Vencimiento de REPO al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023	0.0	0.0	0.0	1 060.0
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 al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023				
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 Excpansion				
Vencimiento de REPO Excpansión al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023				
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 al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023				
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0 300.0 70.0	300.0 299.9 300.0	70.0 200.0	170.0 300.0 20.0
Propuestas recibidas	660.0 833.0 360.0	1040.0 820.0 573.0	730.0 480.0	975.0 540.0 130.0
Plazo de vencimiento	92 d 92 d 92 d	184 d 93 d 97 d	184 d 87 d	183 d 98 d 183 d
Tasas de interés: Mínima	5.96 5.95 5.95	5.49 5.54 5.55	5.65 5.50	5.55 5.55 5.49
Máxima	5.96 5.95 5.94	5.49 5.50 5.58	5.65 5.58	5.60 5.55 5.60
Promedio	5.99 5.95 5.95	5.49 5.51 5.77	5.68 5.99	5.60 5.55 5.60
Saldo	10 681.0	10 681.0	10 680.0	10 370.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 27 de Julio del 2023	800.1	298.0	800.0	517.0
Vencimiento de SC - Venta al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023	1 898.1	1 098.0	800.0	1 727.0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de RED				
Vencimiento de RED al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023				
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	120.0	120.0	120.0	120.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 28 de Julio del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés al 31 de Julio al 04 de agosto de 2023	30.0	30.0	30.0	30.0
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
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.5	0.0	5.2	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.5	0.0	5.2	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	50.5	0.0	51.7	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP (Valorizado)	50.5	0.0	51.7	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 188.5**	**2 517.9**	**2 015.6**	**1 199.8**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
(Contratos Tasa efectiva diaria)	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%
b. Compra temporal directa de valores (Repo de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés				
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	948.0	1 183.0	1 377.0	351.0
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 236.5**	**1 334.9**	**1 442.6**	**848.8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	14 608.8	13 573.4	13 370.4	13 186.7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.1	6.6	6.5	6.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 745.8	6 710.5	6 507.4	6 323.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.8	3.3	3.2	3.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	451.7	600.9	1 132.9	1 111.3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.80 / 7.76	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	47.0	53.5	42.5	42.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25	5.50 / 5.50 / 5.50
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$)	**Jul.24 2023**	**Jul.24 2023**	**Jul.25 2023**	**Jul.26 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + o	13,5	13,5	40,1	-81,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f + g	36,0	36,0	-16,9	-1,7
a. Mercado spot con el público	23,0	23,0	6,5	24,3
i. Compras	917,2	917,2	444,7	505,9
ii. (-) Ventas	894,3	894,3	438,2	481,6
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-82,3	-82,3	133,9	129,8
i. Pactadas	235,5	235,5	214,5	602,7
ii. (-) Vencidas	317,8	317,8	80,6	472,9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-33,7	-33,7	114,8	208,7
i. Pactadas	519,5	519,5	545,4	972,5
ii. (-) Vencidas	553,2	553,2	430,6	763,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	383,1	383,1	355,5	374,1
ii. A futuro	50,0	50,0	20,0	130,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	250,7	250,7	333,8	275,2
i. Compras	537,1	537,1	413,6	746,4
ii. (-) Ventas	286,5	286,5	79,8	471,2
f. Efecto de Opciones	1,2	1,2	-6,2	0,8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	22,7	22,7	36,9	-12,5
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,5897	3,5897	3,6037	3,5985

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera