BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DESCRIBIENDO MONETARIA Y CAMBIARIA

(Millones de Soles)

	03 Ene 23	04 Ene 23	05 Ene 23	06 Ene 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 624,5**	**9 276,1**	**9 480,3**	**10 728,9**
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	12 064,4	12 064,4	12 064,4	12 064,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 20 de Febrero del 2023	1 550,4	1 550,4	1 550,4	1 550,4
Vencimiento CD BCRP 9 al 13 de enero de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2000,0 900,0 3100,0	2900,0 700,0 1800,0 500,0	1000,1 1000,0 1000,0 1000,0 500,0	1000,0 400,0 500,0
Propuestas recibidas	5014,0 1150,0 6120,0	6515,0 2080,0 6300,0 2100,0	2360,0 4480,0 3440,0 2940,0 1100,0	2560,0 1300,0 1860,0
Plazo de vencimiento	1 d 31 d 1 d	1 d 33 d 1 d 1 d	7 d 1 d 1 d 1 d 7 d	3 d 94 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	7,68 6,55 7,85	7,82 6,76 7,80 7,82	7,90 7,85 7,92 7,75 7,96	7,76 6,86 7,76
Máxima	7,82 8,75 8,05	7,91 8,88 8,10 7,89	8,06 7,92 7,97 7,97 7,96	7,80 9,02 7,78
Promedio	7,74 8,66 7,90	7,86 8,82 7,85 7,85	7,99 7,87 7,94 7,76 7,97	7,78 8,94 7,77
Saldo	24 452,6	23 302,6	23 502,7	22 402,7
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 9 de Enero del 2023	6 100,0	4 300,0	3 000,0	1 700,0
Vencimiento de Repo Valores 9 al 13 de enero de 2023	6 100,0	4 300,0	3 000,0	3 454,3
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 9 al 13 de enero de 2023				
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	6 368,9	6 341,7	6 341,7	6 341,7
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Marzo del 2023	2,4	1,2	1,2	1,2
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo 9 al 13 de enero de 2023	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
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
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 9 al 13 de enero de 2023				
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				0,0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez				0,0
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez 9 al 13 de enero de 2023				
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Margen: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	23 098,2	23 098,2	23 098,2	23 098,2
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 13 de Enero del 2023	749,9	749,9	749,9	749,9
Vencimientos de CDV BCRP 9 al 13 de enero de 2023	0,0	0,0	0,0	749,9
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 9 al 13 de enero de 2023				
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo				
Vencimiento de Depósitos a Plazo 9 al 13 de enero de 2023				
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (DOLOCTP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	6 495,8	6 495,8	6 495,8	6 495,8
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de Febrero del 2023	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP 9 al 13 de enero de 2023	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 9 al 13 de enero 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				0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP				
Vencimiento de CDR BCRP 9 al 13 de enero 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 9 al 13 de enero de 2023				
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	200,0	113,0		
Propuestas recibidas	395,0	113,0		
Plazo de vencimiento	7 d	7 d		
Tasas de interés: Mínima	8,10	7,80		
Máxima	8,91	9,06		
Promedio	8,48	8,09		
Saldo	1 312,0	1 125,0	1 125,0	1 125,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 10 de Enero del 2023	300,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO 9 al 13 de enero de 2023	300,0	0,0	0,0	313,0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de recompra				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo				
Vencimiento de REPO 9 al 13 de enero 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 Expansión				
Vencimiento de REPO Expansión 9 al 13 de enero 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 Sustitución				
Vencimiento de REPO Sustitución 9 al 13 de enero de 2023				
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200,0 300,0		200,0 200,0	
Propuestas recibidas	680,0 406,0		760,0 216,5	
Plazo de vencimiento	90 d 90 d		85 d 85 d	
Tasas de interés: Mínima	3,70 3,80		4,05 4,29	
Máxima	3,90 4,25		4,30 4,69	
Promedio	3,88 4,07		4,18 4,56	
Saldo	38 353,9	38 353,9	38 313,9	38 113,9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 9 de Enero del 2023	540,0	540,0	200,0	400,0
Vencimiento de SC - Venta 9 al 13 de enero de 2023	740,0	740,0	200,0	1 935,0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer Bonos (RED)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				0,0
Próximo vencimiento de RED				
Vencimiento de RED 9 al 13 de enero de 2023				
xxii. Subasta de Repo de Tasas de Interés				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	2 270,0	2 270,0	2 220,0	2 220,0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 8 de Enero del 2023	50,0	50,0	100,0	100,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés 9 al 13 de enero de 2023	50,0	50,0	0,0	80,0
b. Liquid. Recoc Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP) 1				
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
d. Operaciones Fx para de Mesa (millones de US$)	0,4	0,1	1,8	0,1
i. Compras (millones de US$)	0,4	0,1	1,8	0,1
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP				
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP (Valoriza)				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**13 416,5**	**13 376,1**	**13 976,0**	**12 629,9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0223%	0,0223%	0,0223%	0,0218%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés				
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	645,0	797,0	1 515,0	1 539,0
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**13 771,5**	**14 173,1**	**15 491,0**	**14 168,9**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 997,0	13 869,8	15 158,5	16 030,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,0	7,3	7,8	8,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 664,3	6 973,5	8 091,8	8 763,3
d. Operaciones Cambiarias Interbancarias acumuladas (% del TOSE) (*)	2,3	3,7	4,1	4,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	298,1	922,7	2 063,8	1 972,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7,50 / 7,60 / 7,52	7,50 / 7,90 / 7,61	7,50 / 7,80 / 7,65	7,50 / 7,60 / 7,53
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	-	-	26,0	36,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	- / - / -	- / - / -	4,50 / 4,50 / 4,50	4,50 / 4,50 / 4,50
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$)	**Dic.30 2022**	**Ene.03 2023**	**Ene.04 2023**	**Ene.05 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-1,7	-5,1	-42,0	100,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	23,2	14,9	41,6	107,9
a. Mercado spot con el público	3,0	34,7	-112,7	118,2
i. Compras	292,5	364,4	399,4	515,0
ii. (-) Ventas	291,6	332,2	512,1	396,8
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	93,7	26,4	148,3	-153,2
i. Pactadas	136,2	89,6	297,8	240,9
ii. (-) Vencidas	52,5	186,3	149,5	394,1
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	111,0	3,0	26,3	-102,9
i. Pactadas	268,6	300,3	193,0	506,0
ii. (-) Vencidas	157,6	296,8	94,6	658,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	227,9	216,1	326,9	485,7
ii. A futuro	23,0	9,0	182,0	10,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	127,2	111,8	26,6	264,9
i. Compras	190,8	281,4	85,3	657,4
ii. (-) Ventas	23,5	169,6	119,9	392,6
f. Efecto de Opciones	0,3	-1,4	-0,4	0,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,3	61,8	7,2	-38,9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,8127	3,8177	3,8281	3,8285

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera