BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	23 Ene 23	24 Ene 23	25 Ene 23	26 Ene 23	27 Ene 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**5 066,8**	**3 864,5**	**4 728,0**	**4 998,6**	**5 036,1**
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)			Declarada		
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento			365 d		
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	13 138,4	13 138,4	13 138,4	13 138,4	13 138,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 20 de Febrero del 2023	1 592,4	1 592,4	1 592,4	1 592,4	1 592,4
Vencimiento de CD BCRP del 30 de enero al 3 de febrero de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					499,0
Propuestas recibidas					1575,0
Plazo de vencimiento					90 d
Tasas de interés: Mínima					8,72
Máxima					8,86
Promedio					8,75
Saldo	9 248,4	9 248,4	9 248,4	9 248,4	8 648,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 30 de Enero del 2023	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Repo Valores del 30 de enero al 3 de febrero de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	800,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					0,0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General					
Vencimiento de Reso de Cartera General del 30 de enero al 3 de febrero de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 341,7	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 30 de enero al 3 de febrero 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	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 30 de enero al 3 de febrero 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					
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 30 de enero al 3 de febrero de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)			300,0 150,0	200,0	300,0
Propuestas recibidas			640,0 150,0	490,0	720,0
Plazo de vencimiento			92 d 92 d	91 d	90 d
Margen: Mínima			-0,10 -0,10	-0,09	-0,10
Máxima			-0,10 -0,10	-0,08	-0,08
Promedio			-0,10 -0,10	-0,08	-0,09
Saldo	16 185,3	16 185,3	15 115,3	15 415,3	14 985,3
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 17 de Febrero del 2023	1 500,0	1 500,0	900,0	900,0	1 509,6
Vencimientos de CDV BCRP del 30 de enero al 3 de febrero de 2023	2 400,0	2 400,0	900,0	900,0	0,0
x. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Procesetas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP					
Vencimiento de CDLD BCRP del 30 de enero al 3 de febrero de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 000,1 1 000,4	2 767,4	3 000,0	3 250,0	4 492,8
Propuestas recibidas	1 365,5 1 600,4	2 760,4	3 532,1	3 427,8	4 492,8
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	7,65 7,00	7,30	7,30	7,30	7,30
Máxima	7,75 7,75	7,75	7,75	7,75	7,75
Promedio	7,72 7,60	7,69	7,68	7,68	7,70
Saldo	3 000,5	3 767,4	3 500,0	3 700,0	4 492,8
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 30 de Enero del 2023	2 500,5	3 267,4	3 000,0	3 700,0	4 492,8
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 30 de enero al 3 de febrero de 2023	3 000,5	3 767,4	3 500,0	3 700,0	4 492,8
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTOP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 495,8	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	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 30 de enero al 3 de febrero de 2023	0,0	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 30 de enero al 3 de febrero 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 del 30 de enero al 3 de febrero de 2023					
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)					
Procesetas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 30 de enero al 3 de febrero de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	752,0	752,0	752,0	752,0	752,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 24 de Marzo del 2023	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO del 30 de enero al 3 de febrero de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de recompra					
Procesetas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso					
Vencimiento de REPO del 30 de enero al 3 de febrero de 2023					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Excepción)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo Excepcion					
Vencimiento de REPO Expansión del 30 de enero al 3 de febrero 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 del 30 de enero al 3 de febrero de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200,1 300,0	299,0 299,0 300,0 500,0	200,0 300,1	200,0 298,0	150,0 300,0 200,0 300,0 200,0 200,0
Propuestas recibidas	560,0 521,0	264,0 670,0 882,0 651,0	355,0 526,0	526,0 298,0	186,0 806,0 720,0 473,0 420,0
Plazo de vencimiento	91 d 91 d	91 d 181 d 181 d 182 d	273 d 181 d	273 d 181 d	273 d 181 d 273 d 181 d 273 d
Tasas de interés: Mínima	5,05 4,80	5,05 5,30 5,19 5,00	5,40 5,35	5,40 5,44	5,49 5,37 5,38 5,33 5,33
Máxima	5,25 5,10	5,25 5,45 5,27 5,37	5,40 5,45	5,50 5,50	5,50 5,43 5,43 5,42 5,42
Promedio	5,20 4,97	5,19 5,40 5,20 5,20	5,40 5,38	5,45 5,46	5,49 5,40 5,40 5,36 5,36
Saldo	36 342,0	36 861,0	36 860,1	36 486,0	36 772,2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de Enero del 2023	800,0	500,0	669,9	927,0	299,0
Vencimiento de SC - Venta del 30 de enero al 3 de febrero de 2023	3 126,9	2 326,9	1 826,9	927,0	1 700,0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (REA)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					0,0
Próximo vencimiento de REO					
Vencimiento de REO del 30 de enero al 3 de febrero de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 850,0	1 850,0	1 850,0	1 780,0	1 780,0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 29 de Enero del 2023	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 30 de enero al 3 de febrero de 2023	80,0	50,0	50,0	0,0	80,0
b. Liquid. Reaos 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$)	0,0	1,2	0,8	0,0	0,0
i. Compras (millones de US$)	0,0	1,2	0,8	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 566,8**	**1 709,5**	**2 864,7**	**2 191,3**	**1 446,5**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0225%	0,0219%	0,0219%	0,0221%	0,0225%
b. Compra temporal directa de valores (Tasa de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	606,0	414,0	344,0	932,0	551,0
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 960,8**	**1 295,5**	**1 740,7**	**1 259,3**	**895,5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13 233,1	12 803,6	12 876,3	12 742,4	12 591,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,7	7,0	6,5	6,4	6,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 015,6	5 869,0	5 658,7	5 525,1	5 371,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,0	3,2	2,9	2,8	2,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 092,3	1 297,9	1 527,6	1 198,9	1 034,1
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7,50 / 7,75 / 7,75	7,50 / 7,80 / 7,75	7,75 / 7,80 / 7,75	7,70 / 7,75 / 7,75	6,90 / 7,80 / 7,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	39,3	49,0	47,6	43,0	29,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	4,70 / 4,70 / 4,70	4,70 / 4,70 / 4,70	4,70 / 4,70 / 4,70	4,70 / 5,25 / 4,98	4,70 / 4,70 / 4,70
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 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo hasta 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**Ene.20 2023**	**Ene.23 2023**	**Ene.24 2023**	**Ene.25 2023**	**Ene.26 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-16,6	53,5	-37,9	-61,0	-1,1
Flujo de la posición contable = a + b.i - c.i + e + g	254,4	80,3	64,7	-49,3	-31,2
a. Mercado spot con el público	488,4	79,1	74,5	-45,3	-24,2
i. Compras	512,8	814,3	431,7	426,3	297,7
ii. (-) Ventas	264,0	735,0	356,4	471,6	321,9
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	41,8	203,2	136,7	34,9	21,7
i. Pactadas	153,9	162,1	199,1	226,6	345,0
ii. (-) Vencidas	111,1	58,9	54,4	264,7	313,3
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	312,2	298,6	197,2	45,5	-67,0
i. Pactadas	383,1	312,8	491,2	380,0	376,3
ii. (-) Vencidas	70,8	14,3	133,9	334,5	443,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	397,1	325,7	264,6	312,4	226,2
ii. A futuro	0,0	60,0	12,0	85,0	60,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-34,1	-0,9	72,5	69,3	127,3
i. Compras	57,4	53,5	126,0	333,3	439,2
ii. (-) Ventas	91,5	54,4	53,5	264,0	311,9
f. Efecto de Opciones	-0,7	-0,3	-0,3	-0,3	-1,6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,6	150,4	122,1	-1,3	-77,6
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,8543	3,8747	3,8857	3,8975	3,8593

(*) Datos preliminares

Elaborado: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera