BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	05 Jun 23	06 Jun 23	07 Jun 23	08 Jun 23	09 Jun 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**5 547,1**	**6 259,2**	**6 996,4**	**6 363,4**	**6 288,9**
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)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	26 478.1	26 478.1	26 478.1	26 478.1	26 478.1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Junio del 2023	600.0	600.0	600.0	600.0	600.0
Vencimiento de CD BCRP del 12 al 16 de junio de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	600.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	3000.0 500.0 2500.0	2000.0 500.0 1500.0	300.0 2300.0	300.0 1300.0	500.0 500.0
Procesadas recibidas	4400.0 1000.0 3050.0	3800.0 800.0 1635.0	400.0 2300.0	850.0 2100.0	1450.0 1000.0
Plazo de vencimiento	1 d 31 d 1 d	1 d 31 d 1 d	30 d 1 d	32 d 1 d	91 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	7.76 8.11 7.75	7.79 8.05 7.76	7.96 7.75	8.03 7.78	8.28 7.81
Máxima	8.10 8.16 7.79	8.07 8.15 7.80	8.10 7.82	8.05 7.79	8.34 7.81
Promedio	7.88 8.14 7.77	7.90 8.11 7.77	8.04 7.79	8.04 7.78	8.31 7.81
Saldo	20 358.4	18 358.4	17 458.4	15 758.4	14 658.4
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 12 de Junio del 2023	6 000.0	3 500.0	3 300.0	2 100.0	1 000.0
Vencimiento de Reco Valores del 12 al 16 de junio de 2023	7 800.0	5 300.0	4 100.0	2 100.0	1 000.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General					
Vencimiento de Repo de Cartera General del 12 al 16 de junio de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 332.2	6 332.2	6 332.2	6 332.2	6 305.8
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 26 de Julio del 2023	3.7	3.7	3.7	3.7	2.5
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 12 al 16 de junio 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					
Procesadas 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					
Procesadas 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)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR					
Vencimiento de Reco Especial - CDR del 12 al 16 de junio de 2023					
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acceso de Liquidez					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco de Cartera para el Acceso de Liquidez					
Vencimiento de Reco de Cartera para el Acceso de Liquidez del 12 al 16 de junio de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Ajustables del BCR (CDV BCRP)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 700.0	1 700.0	1 700.0	1 700.0	1 100.0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 14 de Junio del 2023	600.0	600.0	600.0	600.0	1 100.0
Vencimientos de CDV BCRP del 12 al 16 de junio de 2023	600.0	600.0	600.0	600.0	1 100.0
x. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP					
Vencimiento de CDLD BCRP del 12 al 16 de junio de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 12 al 16 de junio de 2023					
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0				
Procesadas recibidas	450.3				
Plazo de vencimiento	183 d				
Tasas de interés: Mínima	7.86				
Máxima	8.36				
Promedio	8.04				
Saldo	6 861.6	6 861.6	6 861.6	6 861.6	6 861.6
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 16 de Junio del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 12 al 16 de junio de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	300.0
xiii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN del 12 al 16 de junio de 2023					
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Procesadas 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 el 13 de Julio del 2023	60.0	60.0	60.0	60.0	60.0
Vencimiento de CDR BCRP del 12 al 16 de junio de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 12 al 16 de junio de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	200.0	200.0			
Procesadas recibidas	544.0	520.0			
Plazo de vencimiento	31 d	31 d			
Tasas de interés: Mínima	8.00	7.93			
Máxima	8.11	8.01			
Promedio	8.09	7.97			
Saldo	2 397.0	2 597.0	2 597.0	2 297.0	2 297.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 13 de Junio del 2023	300.0	300.0	300.0	500.0	500.0
Vencimiento de REPO del 12 al 16 de junio de 2023	300.0	300.0	300.0	0.0	500.0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco					
Vencimiento de REPO del 12 al 16 de junio de 2023					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 12 al 16 de junio de 2023					
xix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 12 al 16 de junio de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		300.0 170.0 200.0		Desierta	
Procesadas recibidas		900.0 440.0 345.0		-	
Plazo de vencimiento		274 d 274 d 274 d		182 d	
Tasas de interés: Mínima		5.30 5.47 5.54		0.00	
Máxima		5.53 5.60 5.60		0.00	
Promedio		5.43 5.55 5.57		0.00	
Saldo	34 636.3	34 946.3	34 946.3	34 546.3	34 246.3
Próximo vencimiento de SC-Venta el 16 de Junio del 2023	360.0	400.0	400.0	300.0	600.0
Vencimiento de SC - Venta del 12 al 16 de junio de 2023	1 060.0	700.0	700.0	300.0	600.0
xxi. Subasta de Reco de Valores para proveer dólares (RED)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 12 al 16 de junio de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	390.0	360.0	360.0	360.0	330.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 16 de Junio del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 12 al 16 de junio de 2023	60.0	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)					
e. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
i. Compras (millones de US$)	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Tipo de cambio promedio	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	1.5	0.3	1.3	4.3	2.4
i. Compras (millones de US$)	1.5	0.3	1.3	4.3	2.4
ii. Ventas (millones de US$)	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	48.8	0.0	50.6	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	48.8	0.0	50.6	0.0	0.0
ii. Compras de BTP (Vabroker)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**11 996,1**	**10 449,2**	**9 596,4**	**7 963,4**	**7 288,9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	511.3	563.5	811.2	352.0	1 396.0
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**11 484,8**	**9 885,7**	**8 785,2**	**7 611,4**	**5 892,9**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	18 750.8	18 721.3	18 258.1	17 832.0	17 362.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	9.3	9.2	9.0	8.8	8.6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	11 572.3	11 542.8	11 077.6	10 653.5	10 185.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	5.7	5.7	5.5	5.3	5.0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	532.5	1 038.7	1 104.5	1 326.9	1 416.6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.00 / 7.75 / 7.54	7.70 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	52.7	45.0	73.0	78.0	71.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	s.o. / s.o. / s.o.	s.o. / s.o. / s.o.	s.o. / s.o. / s.o.	s.o. / s.o. / s.o.	s.o. / s.o. / s.o.
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CTS					
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$)	**Jun.02 2023**	**Jun.05 2023**	**Jun.06 2023**	**Jun.07 2023**	**Jun.08 2023**
Flujo de la posición global = a + b + c + d + e + f + g	-62.3	52.8	-188.0	84.1	28.5
Flujo de la posición contable = a + b + c + d + e + g	87.6	37.7	-297.0	8.1	-44.0
a. Mercado spot con el público	148.1	56.0	-291.1	21.1	-42.9
i. Compras	449.9	796.4	713.1	476.2	440.7
ii. (-) Ventas	301.8	740.4	1004.3	455.0	483.6
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	53.7	77.9	135.0	241.8	-156.1
i. Pactadas	85.5	141.6	234.5	392.9	439.8
ii. (-) Vencidas	31.8	63.7	99.5	151.2	595.9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	162.3	62.1	110.5	113.8	-223.6
i. Pactadas	406.1	194.7	578.5	525.9	434.3
ii. (-) Vencidas	243.8	132.6	468.0	412.1	657.9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	408.2	266.3	493.5	595.2	446.1
ii. A futuro	154.0	130.0	39.0	99.0	16.0
e. Operaciones swot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entregas	154.2	70.5	361.8	261.2	66.4
i. Compras	185.3	129.4	460.8	410.9	652.0
ii. (-) Ventas	31.1	58.9	99.0	149.7	585.5
f. Efecto de Opciones	-0.4	-0.6	-0.6	1.3	1.2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-43.6	-20.0	86.0	-86.6	-58.8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6861	3.6758	3.6901	3.6703	3.6546

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera