BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	19 Jun 23	20 Jun 23	21 Jun 23	22 Jun 23	23 Jun 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**5 407,8**	**4 489,6**	**3 327,0**	**3 363,6**	**1 452,5**
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)	500.0	300.0	300.0		
Procuestas recibidas	1051.0	1052.0	878.0		
Plazo de vencimiento	183 d	182 d	181 d		
Tasas de interés: Mínima	7.28	7.27	7.28		
Máxima	7.31	7.30	7.29		
Promedio	7.30	7.29	7.29		
Saldo	30 041.9	30 341.9	30 649.9	30 649.9	30 649.9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de Junio del 2023	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de CD BCRP al 26 al 30 de junio de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	500.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				500.0	600.0
Procuestas recibidas				523.0	1500.0
Plazo de vencimiento				1 d	91 d
Tasas de interés: Mínima				7.80	8.33
Máxima				7.80	8.41
Promedio				7.80	8.38
Saldo	14 058.4	14 058.4	14 058.4	14 558.4	14 158.4
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 3 de Julio del 2023	500.0	500.0	500.0	1 000.0	1 500.0
Vencimiento de Reco Valores al 26 al 30 de junio de 2023	500.0	500.0	500.0	1 000.0	0.0
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 Repo de Cartera General					
Vencimiento de Repo de Cartera General al 26 al 30 de junio de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 305.8	6 305.8	6 305.8	6 305.8	6 305.8
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 26 de Julio del 2023	2.5	2.5	2.5	2.5	2.5
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo al 26 al 30 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					
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 Reco Especial - CDR al 26 al 30 de junio 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					
Vencimiento de Reco de Cartera para el Acceso de Liquidez al 26 al 30 de junio de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Ajustables del BCR (CDV BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Máximo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP al 26 al 30 de junio de 2023					
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 al 26 al 30 de junio de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	500.0 1 000.0	500.0 1 400.0	1 000.0 1 800.0	1 000.1	800.0
Procuestas recibidas	1 088.1 2 158.5	1 487.1 2 485.8	2 116.1 2 185.9	2 242.4	1 993.6
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	6.30 6.55	6.50 6.48	6.50 6.33	7.00	6.31
Máxima	7.55 8.70	7.49 8.30	7.50 7.74	7.50	8.00
Promedio	6.87 8.63	7.04 8.04	7.30 7.22	7.37	8.00
Saldo	1 500.0	1 900.0	2 800.0	1 000.1	800.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 26 de Junio del 2023	1 500.0	1 900.0	2 800.0	1 000.1	800.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo al 26 al 30 de junio de 2023	1 500.0	1 900.0	2 800.0	1 000.1	800.0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)			300.0		
Procuestas recibidas			461.6		
Plazo de vencimiento			183 d		
Tasas de interés: Mínima			8.00		
Máxima			8.22		
Promedio			8.11		
Saldo	6 744.3	6 744.3	7 044.3	7 044.3	7 044.3
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Julio del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP al 26 al 30 de junio 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					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN al 26 al 30 de junio 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 el 13 de Julio del 2023	60.0	60.0	60.0	60.0	60.0
Vencimiento de CDR BCRP al 26 al 30 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)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP al 26 al 30 de junio de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 797.0	1 797.0	1 797.0	1 797.0	1 797.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 5 de Julio del 2023	1 000.0	1 000.0	1 000.0	1 000.0	1 000.0
Vencimiento de REPO al 26 al 30 de junio de 2023	0.0	0.0	0.0	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 al 26 al 30 de junio 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 Reco Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión al 26 al 30 de junio 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 al 26 al 30 de junio de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	100.0	200.0		200.0 300.0	
Procuestas recibidas	200.0	655.0		400.0 675.0	
Plazo de vencimiento	365 d	366 d		181 d 273 d	
Tasas de interés: Mínima	5.42	5.39		5.70 5.48	
Máxima	5.52	5.41		5.71 5.54	
Promedio	5.47	5.41		5.70 5.52	
Saldo	33 946.3	33 346.3	33 346.3	33 346.3	33 176.3
Próximo vencimiento de SC-Venta el 26 de Junio del 2023	800.0	670.0	670.0	670.0	800.0
Vencimiento de SC - Venta al 26 al 30 de junio de 2023	1 470.0	670.0	670.0	670.0	3 195.0
xxi. Subasta de Reco de Valores para proveer dólares (RED)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED al 26 al 30 de junio de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	300.0	270.0	270.0	270.0	240.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 30 de Junio del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés al 26 al 30 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)					
c. 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$)	0.0	0.0	1.8	3.2	0.9
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	1.8	3.2	0.9
ii. Ventas (millones de US$)	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	50.5	0.0	48.9	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	50.5	0.0	48.9	0.0	0.0
ii. Compras de BTP (Vabroado)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**5 976,4**	**4 916,1**	**3 589,0**	**3 211,9**	**1 677,8**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 087.0	775.0	93.0	1 752.0	991.0
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2 792,4**	**1 743,1**	**1 216,9**	**1 459,9**	**686,8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	14 623.3	14 308.7	14 001.5	13 721.9	13 510.8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	7.2	7.1	6.9	6.8	6.7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 460.2	7 145.5	6 838.3	6 558.8	6 347.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	3.7	3.5	3.4	3.2	3.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	467.4	932.6	1 163.5	686.1	1 315.7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.75 / 7.75 / 7.75	7.50 / 7.75 / 7.72	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 8.00 / 7.92	7.75 / 7.75 / 7.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	79.0	37.0	88.0	30.8	72.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y BTP					
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.16 2023**	**Jun.19 2023**	**Jun.20 2023**	**Jun.21 2023**	**Jun.22 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + o	-62.9	18.5	-58.9	34.0	104.3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + o	-86.7	36.6	63.4	11.4	39.4
a. Mercado spot con el público	-7.7	43.5	71.0	37.1	54.0
i. Compras	476.7	253.4	1233.0	563.3	549.1
ii. (-) Ventas	484.4	209.9	1162.0	526.2	495.1
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-160.3	1.4	66.5	105.6	-503.7
i. Pactadas	288.5	6.7	336.9	353.9	211.3
ii. (-) Vencidas	448.8	5.3	270.4	248.4	715.0
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-291.8	45.9	36.1	83.0	-569.7
i. Pactadas	329.4	57.5	458.9	370.2	599.0
ii. (-) Vencidas	621.2	11.6	422.8	287.2	1168.8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	529.7	316.5	343.8	527.0	360.1
ii. A futuro	44.0	32.5	204.0	290.4	185.3
e. Operaciones swot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entregas	159.5	3.3	154.8	38.4	464.4
i. Compras	594.7	7.2	417.5	286.0	1113.1
ii. (-) Ventas	435.2	3.9	262.7	247.6	648.7
f. Efecto de Opciones	-1.4	-1.0	-1.4	0.1	-1.2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-172.4	23.5	-161.4	-25.3	-25.1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6332	3.6352	3.6453	3.6418	3.6353

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera