BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	26 Jun 23	27 Jun 23	28 Jun 23	30 Jun 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**2 435,1**	**2 582,6**	**3 038,6**	**1 980,0**
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)				
Propuestas recibidas				200.0
Plazo de vencimiento				337.0
Tasas de interés: Mínima				187 d
Máxima				7.18
Promedio				7.29
Saldo	30 649.9	30 549.9	30 149.9	30 349.9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Julio del 2023	100.0	400.0	872.1	872.1
Vencimiento de CD BCRP al 30 de junio de 2023	500.0	400.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				500.0 600.0 300.0
Propuestas recibidas				1650.0 1850.0 840.0
Plazo de vencimiento				3 d 91 d 3 d
Tasas de interés: Mínima				8.01 8.36 8.15
Máxima				8.01 8.39 8.15
Promedio				8.01 8.38 8.15
Saldo	14 158.4	14 158.4	14 158.4	15 558.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 3 de Julio del 2023	1 500.0	1 500.0	1 500.0	2 300.0
Vencimiento de Repo Valores al 30 de junio de 2023	0.0	0.0	0.0	4 600.0
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 30 de junio 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	6 305.8	6 305.8
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 26 de Julio del 2023	2.5	2.5	2.5	2.5
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo al 30 de junio 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 al 30 de junio de 2023				
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Ahorro de Liquidez				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Ahorro de Liquidez				
Vencimiento de Repo de Cartera para el Ahorro de Liquidez al 30 de junio 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 30 de junio 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 30 de junio de 2023				
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	468.7 1 100.0	300.0 1 400.0	1 600.0	
Propuestas recibidas	468.7 1 452.8	454.0 1 724.7	1 952.5	
Plazo de vencimiento	7 d 1 d	7 d 1 d	2 d	
Tasas de interés: Mínima	6.70 6.60	7.12 6.80	6.67	
Máxima	7.75 7.95	7.74 7.95	7.19	
Promedio	7.55 6.85	7.60 7.74	7.01	
Saldo	1 568.7	1 568.7	1 568.7	768.7
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 30 de Junio del 2023	1 100.0	1 400.0	1 600.0	468.7
Vencimiento de Depósitos a Plazo al 30 de junio de 2023	1 100.0	1 400.0	1 600.0	768.7
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	7 044.3
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Julio del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP al 30 de junio 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 al 30 de junio 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	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
Vencimiento de CDR BCRP al 30 de junio de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0
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 30 de junio de 2023				
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	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
Vencimiento de RREPO al 30 de junio de 2023	0.0	0.0	0.0	1 400.0
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 al 30 de junio 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 Reco Expansion				
Vencimiento de REPO Expansión al 30 de junio 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 Reco Sustitución				
Vencimiento de REPO Sustitución al 30 de junio de 2023				
xx. Subasta de Swap Cambario Venta del BCRP	300.0 200.0 299.9	300.0 70.0	300.0 400.0	300.0
Propuestas recibidas	960.0 770.0 520.0	670.0 190.0	806.0 902.0	775.0
Plazo de vencimiento	366 d 366 d 367 d	366 d 366 d	183 d 183 d	182 d
Tasas de interés: Mínima	5.39 5.38 5.35	5.38 5.48	5.60 5.53	5.49
Máxima	5.41 5.38 5.38	5.44 5.51	5.63 5.60	5.51
Promedio	5.39 5.38 5.36	5.40 5.49	5.62 5.58	5.50
Saldo	33 178.2	32 652.2	32 572.2	32 151.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de Junio del 2023	894.0	780.0	721.0	500.0
Vencimiento de SC - Venta al 30 de junio de 2023	2 395.0	1 501.0	721.0	500.0
xxi. Subasta de Reco 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 30 de junio de 2023				
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	240.0	240.0	240.0	210.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 30 de Junio del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés al 30 de junio 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 Operaciones del BCR	n.o	n.o	n.o	n.o
i. Compras (millones de US$)	n.o	n.o	n.o	n.o
Tipo de cambio promedio	n.o	n.o	n.o	n.o
ii. Ventas (millones de US$)	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$)	23.8	0.1	1.9	0.0
i. Compras (millones de US$)	23.8	0.1	1.9	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	n.o	n.o	n.o	n.o
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	51.9	0.0	50.3	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP (Valorizado)	51.9	0.0	50.3	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**1 437,9**	**1 491,1**	**2 115,6**	**3 197,0**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés				
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	435.0	698.0	996.0	1 396.0
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 002,9**	**793,1**	**1 123,6**	**1 801,0**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 827.9	12 666.9	12 491.2	12 357.6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.4	6.3	6.2	6.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 664.7	5 503.8	5 328.0	5 194.5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.8	2.7	2.6	2.6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	996.1	657.2	922.5	831.7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.75 / 7.75 / 7.75	7.70 / 7.75 / 7.75	7.70 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.80 / 7.77
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	104.9	80.0	-	-
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5.95 / 5.95 / 5.95	5.95 / 5.95 / 5.95	- / - / -	- / - / -
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CTLV				
Plazo hasta 3 meses (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.23 2023**	**Jun.26 2023**	**Jun.27 2023**	**Jun.28 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + o	-83.7	-42.1	84.1	-73.4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + o	-8.1	-18.8	14.7	67.2
a. Mercado spot con el público	-19.4	-14.3	22.4	82.4
i. Compras	594.9	755.7	609.8	641.4
ii. (-) Ventas	614.3	770.0	587.4	559.0
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	-23.8	26.0	-117.5	-324.4
i. Pactadas	136.5	59.4	604.6	177.1
ii. (-) Vencidas	160.3	33.4	722.1	501.4
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	32.7	64.2	-311.3	-193.9
i. Pactadas	275.9	209.1	852.9	642.5
ii. (-) Vencidas	243.2	144.8	1 164.2	836.4
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	443.9	517.4	382.6	416.0
ii. A futuro	149.0	212.0	20.0	68.0
e. Operaciones swap asociadas a swaps o vencimientos de forwards sin entrega	96.7	111.8	437.5	328.0
i. Compras	241.1	135.8	1157.6	824.9
ii. (-) Ventas	144.4	24.1	720.2	496.9
f. Efecto de Opciones	20.3	-1.8	0.4	1.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-41.9	11.9	-127.7	-19.4
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6319	3.6407	3.6356	3.6316
(*) Datos preliminares				

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera