BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	17 Jul 23	19 Jul 23	19 Jul 23	20 Jul 23	21 Jul 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 866,7**	**8 452,9**	**8 048,9**	**7 616,6**	**5 248,8**
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)	200.0	300.0			200.0
Propuestas recibidas	450.0	608.0			573.0
Plazo de vencimiento	182 d	181 d			185 d
Tasas de interés: Mínima	7.17	7.17			7.19
Máxima	7.90	7.94			7.75
Promedio	7.90	7.90			7.91
Saldo	90 868.0	90 191.0	90 191.0	90 191.0	90 393.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Agosto del 2023	911.0	911.0	911.0	911.0	911.0
Vencimiento de CD BCRP al 21 de Julio de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Comora Temporal de Valores (REPO)					600.0
Propuestas recibidas					935.0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					8.05
Máxima					8.38
Promedio					8.27
Saldo	14 808.4	14 808.4	14 808.4	14 808.4	14 903.4
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 21 de Julio del 2023	505.0	505.0	505.0	505.0	500.0
Vencimiento de Reco Valores al 21 de Julio de 2023	505.0	505.0	505.0	505.0	0.0
iii. Subasta de Comora Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco de Cartera General					
Vencimiento de Reco de Cartera General al 21 de Julio de 2023					
iv. Subasta de Comora 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	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 21 de Julio de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	2.5
v. Subasta de Comora 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 Comora 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 Comora 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 Reco Especial - CDR al 21 de Julio de 2023					
viii. Subasta de Comora Temporal de Cartera de Créditos para el Acovo de Liquidez					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco de Cartera para el Acovo de Liquidez					
Vencimientos de Reso de Cartera para el Acovo de Liquidez al 21 de Julio de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mánsen: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP al 21 de Julio 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 21 de Julio de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 923.8 2 454.4	2 000.1 1 286.5	2 000.0 2 251.5	2 000.0 1 736.2	2 000.1 1 000.0
Propuestas recibidas	1 923.8 2 454.4	2 549.2 1 286.5	2 680.5 2 251.5	2 171.4 1 736.2	2 668.0 2 441.4
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	7.27 7.31	7.56 7.60	7.60 7.60	7.60 7.60	7.55 7.60
Máxima	7.75 7.75	7.75 7.75	7.75 7.75	7.75 7.75	7.75 7.75
Promedio	7.66 7.67	7.71 7.74	7.72 7.70	7.74 7.73	7.72 7.69
Saldo	4 378.2	3 286.6	4 251.5	3 736.2	3 900.1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 21 de Julio del 2023	4 378.2	3 286.6	4 251.5	3 736.2	3 900.1
Vencimiento de Depósitos a Plazo al 21 de Julio de 2023	4 378.2	3 286.6	4 251.5	3 736.2	3 900.1
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	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 21 de Julio 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					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN al 21 de Julio 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					
Próximo vencimiento de CDR BCRP					
Vencimiento de CDR BCRP al 21 de Julio 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 al 21 de Julio de 2023					
xvi. Comora con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 257.1	2 257.1	2 257.1	2 257.1	2 257.1
Próximo vencimiento de Reco Regular el 2 de Agosto del 2023	60.0	60.0	60.0	60.0	60.0
Vencimiento de REPO al 21 de Julio de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 21 de Julio 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 Reso Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión al 21 de Julio de 2023					
xix. Comora con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución al 21 de Julio de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			200.0		300.0 300.0
Propuestas recibidas			254.0		1010.0 705.0
Plazo de vencimiento			92 d		276 d 84 d
Tasas de interés: Mínima			6.98		6.89 6.98
Máxima			6.98		6.89 6.98
Promedio			6.98		6.89 6.98
Saldo	90 451.9	90 451.9	90 651.9	90 651.9	90 651.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 21 de Julio del 2023	40.0	40.0	40.0	700.0	520.0
Vencimiento de SC - Venta al 21 de Julio de 2023	740.0	740.0	740.0	700.0	2 416.1
xxi. Subasta de Reso de Valores para sroweer dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED al 21 de Julio de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	150.0	150.0	150.0	150.0	120.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 21 de Julio del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés al 21 de Julio de 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
b. Usual: Repos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP. Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	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$)	1.2	0.6	3.5	1.0	4.6
i. Compras (millones de US$)	1.2	0.6	3.5	1.0	4.6
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP. CD BCRP-NR y BTP	52.5	0.0	49.5	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	52.5	0.0	49.5	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**5 187.3**	**5 077.5**	**4 892.5**	**4 842.6**	**2 754.6**
4. Operaciones monetarias del BCR casi el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%
Operación (tasa efectiva diaria)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Compra temporal diaria de valores (Repo de subasta)					
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	664.0	447.0	329.0	887.0	562.0
Tasa de interés	2.25%	2.25%	2.25%	2.25%	2.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**4 660.3**	**5 236.9**	**4 967.3**	**3 956.6**	**2 192.8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	15 469.1	15 177.5	15 053.4	14 818.7	14 608.8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.6	7.4	7.4	7.2	7.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 606.2	8 314.5	8 190.5	7 965.7	7 745.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.2	4.1	4.0	3.9	3.8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	512.6	1 136.3	584.1	722.0	1 214.8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	79.5	74.5	72.5	81.5	79.0
Tasas de interés: Mínima / Máximo/ Promedio	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25
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$)	**Jul.14 2023**	**Jul.17 2023**	**Jul.18 2023**	**Jul.19 2023**	**Jul.20 2023**
Flujo de la posición global: = a + b.i - c.i + e.i + f.i + g	78,5	78,3	126,5	-60,4	-33,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-148,9	32,6	-56,2	-43,9	10,8
a. Mercado spot con el público	-143,2	36,8	-55,9	-32,6	6,7
i. Compras	817,4	1069,1	609,0	417,3	379,1
ii. (-) Ventas	960,6	1032,3	664,9	450,0	372,3
b. Compras forward y swap al público (con v sin entrega)	155,2	135,0	78,2	5,1	-300,0
i. Pactadas	268,1	186,9	537,3	252,6	322,9
ii. (-) Vencidas	112,9	51,9	459,1	247,5	622,9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-68,7	245,3	-100,2	85,5	-274,2
i. Pactadas	242,5	405,5	437,8	228,0	363,0
ii. (-) Vencidas	311,2	160,2	538,0	162,5	637,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	404,3	175,2	418,6	190,3	263,0
ii. A futuro	65,0	20,0	5,0	60,0	30,0
e. Operaciones sool asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entrega	203,7	106,6	76,4	-90,5	25,1
i. Compras	309,2	156,8	526,3	158,9	631,2
ii. (-) Ventas	105,4	50,2	447,9	247,3	606,0
f. Efecto de Opciones	3,5	-0,6	4,3	-12,0	-7,5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-11,1	-2,4	0,2	50,1	-17,4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,5611	3,5607	3,5523	3,5802	3,5881
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera