BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	31 Jul 23	01 Ago 23	02 Ago 23	03 Ago 23	04 Ago 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**5 062,7**	**6 073,1**	**7 224,7**	**8 997,0**	**7 640,6**
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)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	10 089.9	10 089.9	10 089.9	10 089.9	10 089.9
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 del 7 al 11 de agosto de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)		3000.0 1000.0 2800.0	2000.0 750.0 2450.0	500.0 2400.1	600.0 2900.0
Procuestas recibidas		4410.0 1900.0 3350.0	4160.0 1490.0 3327.0	1100.0 4240.0	1100.0 4440.0
Plazo de vencimiento		1 d 34 d 1 d	1 d 34 d 1 d	34 d 1 d	91 d 3 d
Tasas de interés: Mínima		7.77 7.86 7.75	7.78 7.88 7.76	7.81 7.78	8.26 7.78
Máxima		7.95 7.93 7.88	7.90 7.93 7.81	7.87 7.83	8.28 7.85
Promedio		7.87 7.92 7.81	7.86 7.91 7.78	7.85 7.79	8.27 7.81
Saldo	15 003.4	21 803.4	20 203.4	18 653.5	19 003.4
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 7 de Agosto del 2023	1 000.0	6 800.0	4 450.0	3 150.1	4 400.0
Vencimiento de Reco Valores del 7 al 11 de agosto de 2023	1 750.0	7 550.0	5 200.0	3 150.1	6 300.0
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 Reco de Cartera General					
Vencimiento de Reco de Cartera General del 7 al 11 de agosto de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 303.4	6 303.4	6 303.4	6 303.4	6 303.4
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 31 de Agosto del 2023	1.7	1.7	1.7	1.7	1.7
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 7 al 11 de agosto 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 (Recular)					
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 (Esxecial)					
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 Esxecial - CDR)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Esxecial - CDR					
Vencimiento de Reco Esxecial - CDR del 7 al 11 de agosto de 2023					
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos cara al Aoovo de Liouidez					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco de Cartera cara al Aoovo de Liouidez					
Vencimientos de Reco de Cartera cara al Aoovo de Liouidez del 7 al 11 de agosto de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Máximo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 7 al 11 de agosto 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 del 7 al 11 de agosto de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 376.8 2 005.2				
Procuestas recibidas	1 376.8 2 005.2				
Plazo de vencimiento	1 d 1 d				
Tasas de interés: Mínima	7.70 7.65				
Máxima	7.75 7.75				
Promedio	7.74 7.74				
Saldo	3 382.0				
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	3 382.0				
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 7 al 11 de agosto de 2023	3 382.0				
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.1				
Procuestas recibidas	527.1				
Plazo de vencimiento	184 d				
Tasas de interés: Mínima	8.90				
Máxima	8.95				
Promedio	8.95				
Saldo	7 044.4	7 044.4	7 044.4	7 044.4	7 044.4
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 21 de Agosto del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 7 al 11 de agosto 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 del 7 al 11 de agosto de 2023					
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					130.0
Procuestas recibidas					130.0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					5.37
Máxima					5.50
Promedio					5.43
Saldo					130.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 3 de Noviembre del 2023					130.0
Vencimiento de CDR BCRP del 7 al 11 de agosto de 2023					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 del 7 al 11 de agosto de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Recular)		500.0	500.0	300.0	
Procuestas recibidas		845.0	751.0	449.8	
Plazo de vencimiento		34 d	7.87	34 d	
Tasas de interés: Mínima		7.87	7.87	7.88	
Máxima		8.15	8.00	7.95	
Promedio		7.98	7.90	7.89	
Saldo	2 257.1	2 757.1	3 197.1	3 497.1	2 497.1
Próximo vencimiento de Reco Recular el 7 de Agosto del 2023	60.0	60.0	1 000.0	1 000.0	500.0
Vencimiento de REPO del 7 al 11 de agosto de 2023	1 060.0	1 060.0	1 000.0	1 000.0	800.1
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 del 7 al 11 de agosto 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 Excansion					
Vencimiento de REPO Excansión del 7 al 11 de agosto 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 del 7 al 11 de agosto de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300.0 200.0 100.0	200.0 300.0		300.0 300.0 199.9	300.1 300.0 225.0
Procuestas recibidas	630.0 480.0 233.0	400.0 518.0		800.0 995.0 428.0	865.0 595.0 225.0
Plazo de vencimiento	92 d 366 d 34 d	366 d 366 d		365 d 92 d 92 d	367 d 94 d 94 d
Tasas de interés: Mínima	5.95 5.15 5.95	5.95 5.95		5.19 5.35 5.17	5.19 5.07 5.15
Máxima	5.95 5.43 5.95	5.95 5.94		5.34 5.35 5.35	5.19 5.95 5.55
Promedio	5.95 5.31 5.95	5.95 5.95		5.22 5.35 5.29	5.19 5.91 5.54
Saldo	10 356.0	10 356.0	10 706.0	10 906.0	10 514.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 7 de Agosto del 2023	200.0	700.0	700.0	310.0	200.0
Vencimiento de SC - Venta del 7 al 11 de agosto de 2023	1 210.0	1 010.0	1 010.0	310.0	200.0
xxi. Subasta de Reco de Valores cara anower dólares (RED)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 7 al 11 de agosto de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	90.0	90.0	90.0	90.0	60.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 2 de Setiembre del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 7 al 11 de agosto de 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	0.0
b. Liquid. Reros 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$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	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$)	9.7	0.2	2.8	0.7	0.0
i. Compras (millones de US$)	9.7	0.2	2.8	0.7	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	53.0	0.0	49.6	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	53.0	0.0	49.6	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 769.6**	**13 333.1**	**12 881.7**	**12 180.5**	**11 010.8**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%
(Tasa(s) de interés efectiva diaria)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Compra temporal diaria de valores (Repo de subasta)					
Tasa de interés					
c. Crédito por reputación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 600.8	0.0	50.0	0.0	155.9
Tasa de interés	6.25%	6.25%	7.25%	6.25%	6.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 167.8**	**13 333.1**	**12 831.7**	**12 180.5**	**10 854.9**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 967.2	12 327.7	20 318.3	19 984.0	19 606.6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.3	6.0	9.9	9.7	9.5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado millones de S/)	6 104.2	5 464.7	13 333.1	12 998.8	12 621.4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.0	2.7	6.5	6.3	6.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	809.8	226.7	351.3	723.4	963.9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	0.00 / 0.00 / 7.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	42.5	-	5.0	18.0	60.0
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
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo hasta 1 mes o menos (monto / tasa ponderado)					
Plazo hasta 6 meses (monto / tasa ponderado)					
Plazo hasta 12 meses (monto / tasa ponderado)					
Plazo hasta 24 meses (monto / tasa ponderado)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**Jul.27 2023**	**Jul.31 2023**	**Ago.01 2023**	**Ago.02 2023**	**Ago.03 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e.1 + o	-27,4	-68,7	44,1	-30,7	-67,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	66,7	24,4	-102,3	-66,8	-84,5
a. Mercado spot con el público	75,3	36,0	-54,4	-58,1	-73,0
i. Compras	405,9	713,2	756,0	1048,8	866,6
ii. (-) Ventas	330,5	677,2	810,4	1106,9	939,6
b. Compras forward y swap al público (con v sin entrega)	-51,9	96,5	-154,6	94,2	-474,8
i. Pactadas	156,6	385,8	229,9	217,8	200,3
ii. (-) Vencidas	208,5	289,3	384,6	123,6	675,0
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-29,5	237,9	-222,9	48,1	-446,6
i. Pactadas	280,9	557,5	622,3	733,0	555,3
ii. (-) Vencidas	310,4	319,6	845,3	685,0	1001,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	281,6	256,4	296,0	307,7	510,2
ii. A futuro	42,0	0,0	138,0	110,0	79,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entregs	99,6	25,8	421,6	599,3	312,5
i. Compras	306,2	312,1	804,0	682,4	976,9
ii. (-) Ventas	206,6	286,3	382,4	123,1	664,4
f. Efecto de Opciones	0,0	-3,6	-7,5	-10,1	-12,3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-77,9	24,9	76,7	-6,6	40,3
h. Crédito por reputación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.5963	3.6105	3.6354	3.6639	3.6992
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera