# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

(Millones de Soles)

| | 28 Ago 23 | 29 Ago 23 | 31 Ago 23 | 01 Set 23 |
|---|---|---|---|---|
| **1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP** | **7 674,6** | **8 033,6** | **7 788,4** | **6 676,5** |
| **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) | 200.0 | 200.0 100.0 | 200.0 100.0 | |
| Propuestas recibidas | 250.0 | 230.0 311.0 | 453.0 305.0 | |
| Plazo de vencimiento | 184 d | 183 d 365 d | 181 d 363 d | |
| Tasas de interés: Mínima | 7.01 | 7.17 6.55 | 7.00 6.57 | |
| Máxima | 7.17 | 7.18 6.65 | 7.17 6.61 | |
| Promedio | 7.14 | 7.18 6.60 | 7.15 6.60 | |
| Saldo | 33 258.7 | 33 556.7 | 33 856.7 | 33 756.7 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP al 8 de Setiembre del 2023 | 150.0 | 150.0 | 150.0 | 500.0 |
| Vencimiento de CD BCRP del 4 al 8 de setiembre de 2023 | 150.0 | 150.0 | 150.0 | 500.0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | | | | 3000.0 600.0 300.0 2600.0 |
| Propuestas recibidas | | | | 3550.0 1000.0 750.0 2724.0 |
| Plazo de vencimiento | | | | 3 d 91 d 31 d 3 d |
| Tasas de interés: Mínima | | | | 7.77 7.83 7.86 7.76 |
| Máxima | | | | 7.85 7.88 7.90 7.82 |
| Promedio | | | | 7.80 7.86 7.89 7.79 |
| Saldo | 15 203.4 | 15 203.4 | 15 203.4 | 21 203.4 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores al 4 de Setiembre del 2023 | 500.0 | 500.0 | 500.0 | 6 600.0 |
| Vencimiento de Repo Valores del 4 al 8 de setiembre de 2023 | 500.0 | 500.0 | 500.0 | 10 050.0 |
| 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 del 4 al 8 de setiembre de 2023 | | | | |
| iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | 6 303.4 | 6 303.4 | 6 301.7 | 6 301.7 |
| Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 7 de Setiembre del 2023 | 1.7 | 1.7 | 0.9 | 0.9 |
| Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 4 al 8 de setiembre de 2023 | 1.7 | 1.7 | 0.0 | 0.9 |
| 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 del 4 al 8 de setiembre de 2023 | | | | |
| viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acceso de Liquidez | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | | | | |
| Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez | | | | |
| Vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez del 4 al 8 de setiembre 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 del 4 al 8 de setiembre 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 4 al 8 de setiembre de 2023 | | | | |
| xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP) | 3 780.7 1 882.5 | 3 434.2 2 667.3 | 3 756.2 2 899.5 | |
| Propuestas recibidas | 3 780.7 1 882.5 | 3 434.2 2 667.3 | 3 756.2 2 899.5 | |
| Plazo de vencimiento | 1 d 1 d | 2 d 2 d | 1 d 1 d | |
| Tasas de interés: Mínima | 7.65 7.67 | 7.65 7.65 | 6.00 7.50 | |
| Máxima | 7.75 7.75 | 7.75 7.75 | 7.75 7.75 | |
| Promedio | 7.73 7.75 | 7.73 7.71 | 7.73 7.73 | |
| Saldo | 5 663.2 | 6 101.5 | 6 655.7 | 6 655.7 |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo | 5 663.2 | 6 101.5 | 6 655.7 | |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo del 4 al 8 de setiembre de 2023 | 5 663.2 | 6 101.5 | 6 655.7 | |
| xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP) | 300.0 | | | 200.0 |
| Propuestas recibidas | 518.6 | | | 408.7 |
| Plazo de vencimiento | 184 d | | | 185 d |
| Tasas de interés: Mínima | 7.60 | | | 7.65 |
| Máxima | 7.84 | | | 7.90 |
| Promedio | 7.73 | | | 7.71 |
| Saldo | 6 844.4 | 6 844.4 | 6 844.4 | 6 744.4 |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 4 de Setiembre del 2023 | 300.0 | 300.0 | 300.0 | 300.0 |
| Vencimiento de Coloc-TP del 4 al 8 de setiembre de 2023 | 300.0 | 300.0 | 300.0 | 533.9 |
| 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 del 4 al 8 de setiembre 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 | 280.0 | 280.0 | 280.0 | 280.0 |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP el 3 de Noviembre del 2023 | 130.0 | 130.0 | 130.0 | 130.0 |
| Vencimiento de CDR BCRP del 4 al 8 de setiembre 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 del 4 al 8 de setiembre de 2023 | | | | |
| xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular) | | | | 200.0 |
| Propuestas recibidas | | | | 402.0 |
| Plazo de vencimiento | | | | 31 d |
| Tasas de interés: Mínima | | | | 7.90 |
| Máxima | | | | 7.91 |
| Promedio | | | | 7.90 |
| Saldo | 1 697.0 | 1 697.0 | 1 697.0 | 1 897.0 |
| Próximo vencimiento de Repo Regular al 4 de Setiembre del 2023 | 500.0 | 500.0 | 500.0 | 500.0 |
| Vencimiento de REPO del 4 al 8 de setiembre de 2023 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 1 300.0 |
| 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 4 al 8 de setiembre 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 del 4 al 8 de setiembre 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 Sustitucion | | | | |
| Vencimiento de REPO Sustitución del 4 al 8 de setiembre de 2023 | | | | |
| xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | | 200.0 | | 200.0 200.0 200.0 |
| Propuestas recibidas | | 630.0 | | 590.0 585.0 280.0 |
| Plazo de vencimiento | | 92 d | | 91 d 91 d 368 d |
| Tasas de interés: Mínima | | 5.27 | | 5.36 5.39 5.29 |
| Máxima | | 5.32 | | 5.45 5.39 5.50 |
| Promedio | | 5.29 | | 5.43 5.39 5.43 |
| Saldo | 35 021.2 | 34 721.2 | 34 721.2 | 34 721.2 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 5 de Setiembre del 2023 | 500.0 | 600.0 | 600.0 | 600.0 |
| Vencimiento de SC - Venta del 4 al 8 de setiembre de 2023 | 1 100.0 | 600.0 | 600.0 | 1 164.0 |
| 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 del 4 al 8 de setiembre de 2023 | | | | |
| xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | 60.0 | 60.0 | 60.0 | 60.0 |
| Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 2 de Setiembre del 2023 | 30.0 | 30.0 | 30.0 | 30.0 |
| Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 4 al 8 de setiembre de 2023 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| 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.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$) | 0.7 | 0.2 | 9.5 | 5.1 |
| i. Compras (millones de US$) | 0.7 | 0.2 | 9.5 | 5.1 |
| ii. Ventas (millones de US$) | n.o | n.o | n.o | n.o |
| e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP | 75.7 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR | | | | |
| ii. Compras de BTP (Valorizado) | 75.7 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| **3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones** | **2 924,6** | **2 583,6** | **1 788,4** | **13 574,5** |
| **4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones** | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0.0221% | 0.0221% | 0.0221% | 0.0221% |
| b. Compra temporal directa de valores (Repos de subasta) | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| Tasa de interés | | | | |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | |
| Tasa de interés | | | | |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 1 374.0 | 1 249.5 | 1 152.5 | 0.0 |
| Tasa de interés | 5.25% | 5.25% | 5.25% | 5.25% |
| **5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones** | **1 550,6** | **1 334,1** | **635,9** | **13 574,5** |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*) | 13 088.6 | 12 943.9 | 12 779.6 | 12 456.2 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 6.3 | 6.2 | 6.2 | 6.2 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 6 130.2 | 5 985.5 | 5 821.3 | 5 497.8 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 3.0 | 2.9 | 2.8 | 2.7 |
| **6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP** | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 700.0 | 700.0 | 281.0 | 371.8 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO | 7.75 / 7.75 / 7.75 | 7.75 / 7.75 / 7.75 | 7.75 / 7.75 / 7.75 | 7.75 / 7.75 / 7.75 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$) | 67.0 | 151.0 | 123.0 | 68.0 |
| 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 BTP | | | | |
| 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$)** | **Ago.25 2023** | **Ago.28 2023** | **Ago.29 2023** | **Ago.31 2023** |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + o | 75.2 | 78.3 | -117.1 | 101.0 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + o | -136.4 | -35.0 | 105.9 | 42.4 |
| a. Mercado spot con el público | -131.7 | -36.7 | 116.1 | 46.2 |
| i. Compras | 592.9 | 335.6 | 557.5 | 714.1 |
| ii. (-) Ventas | 724.6 | 372.3 | 441.5 | 667.8 |
| b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega) | 290.0 | 27.0 | 106.1 | -118.1 |
| i. Pactadas | 328.6 | 547.3 | 273.8 | 326.1 |
| ii. (-) Vencidas | 38.6 | 520.4 | 167.8 | 444.2 |
| c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega) | 30.0 | -86.1 | 254.5 | -176.9 |
| i. Pactadas | 186.1 | 496.9 | 557.4 | 568.1 |
| ii. (-) Vencidas | 156.1 | 583.0 | 302.9 | 745.0 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | |
| i. Al contado | 355.4 | 433.8 | 479.3 | 553.9 |
| ii. A futuro | 125.0 | 0.0 | 75.0 | 99.0 |
| e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 113.6 | 64.6 | 132.0 | 298.5 |
| i. Compras | 151.4 | 574.2 | 292.7 | 721.0 |
| ii. (-) Ventas | 37.8 | 509.6 | 160.7 | 421.5 |
| f. Efecto de Opciones | 0.8 | 0.3 | 0.9 | -0.1 |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -50.0 | -0.3 | -82.6 | -2.5 |
| h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | |
| Tasa de interés | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3.6927 | 3.6952 | 3.6917 | 3.6964 |

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera