## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**
**(Millones de Soles)**

| | 05 Dic 22 | 06 Dic 22 | 07 Dic 22 |
|---|---|---|---|
| **1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP** | **3 501,9** | **4 938,5** | **1 939,9** |
| **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 | | | |
| Plazo de vencimiento | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | |
| Máxima | | | |
| Promedio | | | |
| Saldo | 12 394,4 | 12 394,4 | 12 394,4 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de Diciembre del 2022 | 450.0 | 450.0 | 450.0 |
| Vencimiento de CD BCRP del 08 al 09 de diciembre de 2022 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | 4000.1 1000.0 500.0 1700.0 | 4000.0 2000.0 | 4800.0 1720.0 |
| Propuestas recibidas | 6595.0 2325.0 1100.0 4600.0 | 6570.0 2330.0 | 4800.0 1720.0 |
| Plazo de vencimiento | 1 d 1 d 7 d 1 d | 1 d 1 d | 5 d 5 d |
| Tasas de interés: Mínima | 7.35 7.34 7.39 7.34 | 7.34 7.34 | 7.26 7.26 |
| Máxima | 7.41 7.38 7.39 7.39 | 7.41 7.37 | 7.39 7.51 |
| Promedio | 7.38 7.36 7.39 7.36 | 7.37 7.35 | 7.35 7.42 |
| Saldo | 17 148,5 | 17 148,5 | 15 968,4 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 12 de Diciembre del 2022 | 6 700,1 | 6 700,1 | 7 920,0 |
| Vencimiento de Repo Valores del 08 al 09 de diciembre de 2022 | 7 700.1 | 13 700.1 | 0.0 |
| 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 08 al 09 de diciembre de 2022 | | | |
| iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo) | | | |
| Propuestas recibidas | | | |
| Plazo de vencimiento | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | |
| Máxima | | | |
| Promedio | | | |
| Saldo | 6 378,6 | 6 378,6 | 6 378,6 |
| Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 26 de Diciembre del 2022 | 9,7 | 9,7 | 9,7 |
| Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 08 al 09 de diciembre de 2022 | 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 |
| 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 |
| 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 08 al 09 de diciembre de 2022 | | | |
| viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Apoyo de Liquidez | | | |
| Propuestas recibidas | | | |
| Plazo de vencimiento | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | |
| Máxima | | | |
| Promedio | | | |
| Saldo | | | |
| Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez | | | |
| Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 08 al 09 de diciembre de 2022 | | | |
| ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP) | | | |
| Propuestas recibidas | | | |
| Plazo de vencimiento | | | |
| Márgen: Mínima | | | |
| Máxima | | | |
| Promedio | | | |
| Saldo | 14 970,6 | 14 970,6 | 14 970,6 |
| Próximo vencimiento de CDV BCRP el 12 de Diciembre del 2022 | 1 818.8 | 1 818.8 | 1 818.8 |
| Vencimientos de CDV BCRP del 08 al 09 de diciembre de 2022 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| 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 08 al 09 de diciembre de 2022 | | | |
| xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP) | | | |
| Propuestas recibidas | | | |
| Plazo de vencimiento | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | |
| Máxima | | | |
| Promedio | | | |
| Saldo | | | |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo | | | |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo del 08 al 09 de diciembre de 2022 | | | |
| xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP) | 300.0 | | |
| Propuestas recibidas | 549,3 | | |
| Plazo de vencimiento | 182 d | | |
| Tasas de interés: Mínima | 7.65 | | |
| Máxima | 8.35 | | |
| Promedio | 7.87 | | |
| Saldo | 6 495,8 | 6 495,8 | 6 495,8 |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 16 de Diciembre del 2022 | 300.0 | 300.0 | 300.0 |
| Vencimiento de Coloc-TP del 08 al 09 de diciembre de 2022 | 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 del 08 al 09 de diciembre de 2022 | | | |
| 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 del 08 al 09 de diciembre de 2022 | | | |
| 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 08 al 09 de diciembre de 2022 | | | |
| xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular) | 500.0 | | |
| Propuestas recibidas | 1050,0 | | |
| Plazo de vencimiento | 7 d | | |
| Tasas de interés: Mínima | 7,86 | | |
| Máxima | 7,99 | | |
| Promedio | 7.90 | | |
| Saldo | 3 512,0 | 3 512,0 | 2 312,0 |
| Próximo vencimiento de Repo Regular el 12 de Diciembre del 2022 | 1 200.0 | 1 200.0 | 1 200.0 |
| Vencimiento de REPO del 08 al 09 de diciembre de 2022 | 1 200,0 | 1 200,0 | 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 Repo | | | |
| Vencimiento de REPO del 08 al 09 de diciembre de 2022 | | | |
| 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 Repo Expansion | | | |
| Vencimiento de REPO Expansión del 08 al 09 de diciembre de 2022 | | | |
| 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 Repo Sustitucion | | | |
| Vencimiento de REPO Sustitución del 08 al 09 de diciembre de 2022 | | | |
| xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | Desierta 80.0 100.0 200.0 | 300.0 | 300.0 Desierta |
| Propuestas recibidas | -.- 460,0 250,0 425,0 | 360,0 | 575,0 -.- |
| Plazo de vencimiento | 91 d 91 d 274 d 91 d | 90 d | 90 d 90 d |
| Tasas de interés: Mínima | 0,00 4,35 4,80 4,05 | 4,40 | 2,50 - |
| Máxima | 0.00 4.40 5.00 4.10 | 4,69 | 2.90 - |
| Promedio | 0.00 4.39 4.87 4.06 | 4.54 | 2.83 - |
| Saldo | 38 163,9 | 38 163,9 | 38 413,9 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 16 de Diciembre del 2022 | 300.0 | 300.0 | 200.0 |
| Vencimiento de SC - Venta del 08 al 09 de diciembre de 2022 | 350,0 | 350,0 | 0,0 |
| xxi. Subasta de Repo 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 08 al 09 de diciembre de 2022 | | | |
| xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés | 30.0 | 30.0 | |
| Propuestas recibidas | 90,0 | 75,0 | |
| Plazo de vencimiento | 90 d | 182 d | |
| Tasas de interés: Mínima | 7,27 | 7.26 | |
| Máxima | 7.27 | 7.26 | |
| Promedio | 7,27 | 7,26 | |
| Saldo | 2 740,1 | 2 740,1 | 2 720,1 |
| Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 11 de Diciembre del 2022 | 50.0 | 50.0 | 50.0 |
| Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 08 al 09 de diciembre de 2022 | 50,0 | 50,0 | 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 | 0,0 | 0,0 | 39,0 |
| i. Compras (millones de US$) | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| Tipo de cambio promedio | 0,0000 | 0,0000 | 0,0000 |
| ii. Ventas (millones de US$) | 0.0 | 0.0 | 10.0 |
| Tipo de cambio promedio | 0.0000 | 0.0000 | 3.8640 |
| d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$) | 3,5 | 6,8 | 0,3 |
| i. Compras (millones de US$) | 3.5 | 6.8 | 0.3 |
| ii. Ventas (millones de US$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP | | | |
| i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR | | | |
| ii. Compras de BTP (Valorizado) | 185,0 | 185,0 | 0,0 |
| **3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones** | **11 491,0** | **10 938,5** | **8 420,9** |
| **4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones** | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0.0194% | 0.0195% | 0.0196% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| Tasa de interés | | | |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | |
| Tasa de interés | | | |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 745.0 | 454.0 | 956.4 |
| Tasa de interés | 5.25% | 5.25% | 5.00% |
| **5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones** | **10 746.0** | **10 484.5** | **7 464.5** |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*) | 18 691,1 | 18 495,2 | 18 356,1 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 9.5 | 9.3 | 9.3 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 11 386.9 | 11 199.2 | 11 059.7 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 5.8 | 5.7 | 5.6 |
| **6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP** | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 914,6 | 1 338,1 | 715,9 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO | 7.25 / 7.35 / 7.31 | 7.25 / 7.35 / 7.33 | 7.25 / 7.35 / 7.27 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$) | 1.0 | 28,0 | 57,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio | 4.00 / 4.00 / 4.00 | 4.00 / 4.00 / 4.00 | 4.00 / 4.50 / 4.25 |
| 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$)** | **Dic.02 2022** | **Dic.05 2022** | **Dic.06 2022** |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g | -11,5 | -0,9 | 116,4 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g | 20,5 | 155,9 | -33,8 |
| a. Mercado spot con el público | 17,5 | 82,0 | -24,0 |
| i. Compras | 384,2 | 775,6 | 457,0 |
| ii. (-) Ventas | 366,6 | 693,6 | 481,0 |
| b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega) | 127,6 | -107,5 | 140,6 |
| i. Pactadas | 168,0 | 226,6 | 431,9 |
| ii. (-) Vencidas | 40,4 | 334,1 | 291,3 |
| c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega) | 137,1 | -43,7 | -5,4 |
| i. Pactadas | 361,0 | 397,9 | 749,1 |
| ii. (-) Vencidas | 223,9 | 441,6 | 754,5 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | |
| i. Al contado | 279,0 | 570,0 | 448,2 |
| ii. A futuro | 74,0 | 48,0 | 72,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 187.2 | 186.9 | 463.4 |
| i. Compras | 218,9 | 440,4 | 753,2 |
| ii. (-) Ventas | 31,7 | 253,5 | 289,8 |
| f. Efecto de Opciones | 0.8 | -0.4 | -0.1 |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -23,9 | -98,1 | -5,7 |
| h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | |
| Tasa de interés | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,8326 | 3,8497 | 3,8497 |
| (*) Datos preliminares | | | |

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera