BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	12 Dic 22	13 Dic 22	14 Dic 22	15 Dic 22	16 Dic 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**2 694,8**	**3 873,0**	**4 745,0**	**4 947,7**	**5 858,1**
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	12 394,4	12 394,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de Diciembre del 2022	450,0	450,0	450,0	450,0	450,0
Vencimiento de CD BCRP del 15 al 16 de diciembre de 2022	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1500,0 300,0 254,2 1100,0	500,0 500,0	500,0 500,0	500,0	300,0
Propuestas recibidas	3500,0 500,0 650,0 2200,0	1165,0 665,0	1165,0 1195,0	1045,0	980,0
Plazo de vencimiento	1 d 93 d 31 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d	91 d
Tasas de interés: Mínima	7,55 8,16 8,10 7,59	7,70 7,77	7,80 7,84	7,84	8,55
Máxima	7,62 8,23 8,10 7,67	7,82 7,85	7,87 7,88	7,88	8,66
Promedio	7,59 8,21 8,10 7,63	7,77 7,82	7,84 7,86	7,86	8,61
Saldo	11 302,6	9 602,6	9 602,6	8 002,6	7 602,6
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 15 de Diciembre del 2022	2 700,0	1 000,0	2 100,0	700,0	200,0
Vencimiento de Repo Valores del 15 al 16 de diciembre de 2022	3 400,0	1 700,0	2 300,0	700,0	200,0
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 Reso de Cartera General del 15 al 16 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	6 378,6	6 378,6
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativo el 26 de Diciembre del 2022	9,7	9,7	9,7	9,7	9,7
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 15 al 16 de diciembre de 2022	0,0	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	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	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 15 al 16 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 15 al 16 de diciembre de 2022					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					1000,0
Propuestas recibidas					2095,0
Plazo de vencimiento					91 d
Mínimo: Mínima					-0,03
Máxima					-0,02
Promedio					-0,03
Saldo	13 151,8	13 151,8	13 151,8	13 151,8	11 856,6
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 16 de Diciembre del 2022	2 457,7	2 457,7	2 457,7	2 457,7	1 199,6
Vencimientos de CDV BCRP del 15 al 16 de diciembre de 2022	2 457,7	2 457,7	2 457,7	2 457,7	1 999,6
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 15 al 16 de diciembre de 2022					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)					1 800,0
Propuestas recibidas					2 248,8
Plazo de vencimiento					3 d
Tasas de interés: Mínima					6,27
Máxima					7,19
Promedio					6,87
Saldo					1 800,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo					1 800,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 15 al 16 de diciembre de 2022					1 800,0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					300,0
Propuestas recibidas					780,3
Plazo de vencimiento					182 d
Tasas de interés: Mínima					8,37
Máxima					8,72
Promedio					8,48
Saldo	6 495,8	6 495,8	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	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 15 al 16 de diciembre de 2022	300,0	300,0	300,0	300,0	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 15 al 16 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 15 al 16 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 15 al 16 de diciembre de 2022					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)		300,0			
Propuestas recibidas		821,5			
Plazo de vencimiento		7 d			
Tasas de interés: Mínima		7,92			
Máxima		8,21			
Promedio		7,94			
Saldo	1 112,0	1 412,0	1 412,0	1 412,0	1 412,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 20 de Diciembre del 2022	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO del 15 al 16 de diciembre de 2022	0,0	0,0	0,0	0,0	600,0
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 15 al 16 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 15 al 16 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 15 al 16 de diciembre de 2022					
xx. Subasta de Swap Cambario Venta del BCRP		40,0			
Propuestas recibidas		46,0			
Plazo de vencimiento		90 d			
Tasas de interés: Mínima		4,30			
Máxima		4,69			
Promedio		4,52			
Saldo	38 413,9	38 453,9	38 453,9	38 453,9	38 253,9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 16 de Diciembre del 2022	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de SC - Venta del 15 al 16 de diciembre de 2022	200,0	200,0	200,0	200,0	0,0
xxi. Subasta de Reso de Valores para arrower ddaras (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 15 al 16 de diciembre de 2022					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés	30,0	Desierta			30,0
Propuestas recibidas	75,0	-			45,0
Plazo de vencimiento	90 d	182 d			274 d
Tasas de interés: Mínima	7,30	0,00			7,10
Máxima	7,32	0,00			7,10
Promedio	7,31	0,00			7,10
Saldo	2 670,1	2 670,1	2 620,1	2 620,1	2 650,1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 16 de Diciembre del 2022	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 15 al 16 de diciembre de 2022	50,0	50,0	0,0	0,0	80,0
b. Liquid. Reoss Carteras 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$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	1,0	0,0	3,0	0,2	3,5
i. Compras (millones de US$)	1,0	0,0	3,0	0,2	3,5
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	210,1	0,0	136,4		169,8
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**5 994,8**	**5 174,0**	**5 715,0**	**5 347,7**	**4 159,1**
4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0,0222%	0,0223%	0,0222%	0,0221%	0,0213%
Tasa de interés	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	833,0	1 057,9	531,0	867,9	1 266,0
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**6 161,8**	**4 116,1**	**5 184,0**	**4 479,8**	**2 893,1**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	17 533,1	16 124,1	15 705,0	15 133,1	15 298,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,9	8,1	7,9	7,6	7,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	10 232,9	8 813,8	8 403,6	8 260,2	7 979,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,2	4,4	4,2	4,2	4,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	2 014,1	2 069,4	2 218,9	1 509,3	1 485,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7,50 / 7,65 / 7,54	7,50 / 7,65 / 7,56	7,00 / 7,55 / 7,50	7,50 / 7,55 / 7,50	7,50 / 7,50 / 7,50
Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	71,8	33,8	48,8	46,8	51,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	4,00 / 4,05 / 4,01	4,00 / 4,05 / 4,01	4,00 / 4,00 / 4,00	4,00 / 4,50 / 4,34	4,50 / 4,50 / 4,50
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.07 2022**	**Dic.12 2022**	**Dic.13 2022**	**Dic.14 2022**	**Dic.15 2022**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-169,3	35,7	-49,4	43,3	-4,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-214,5	-78,1	54,1	22,0	54,1
a. Mercado spot con el público	-247,6	-89,2	49,8	24,8	62,1
i. Compras	437,9	754,6	630,1	1184,4	542,6
ii. (-) Ventas	685,5	843,8	580,3	1159,7	480,5
b. Compras forward y swap al público (con v sin entrega)	159,5	15,8	-116,1	106,8	-212,6
i. Pactadas	295,6	474,4	232,4	291,2	323,8
ii. (-) Vencidas	136,2	458,6	348,5	184,4	536,4
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	180,0	-97,7	-21,6	80,7	-155,2
i. Pactadas	432,2	502,2	448,1	329,6	409,8
ii. (-) Vencidas	252,2	600,0	469,6	248,9	565,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	331,2	711,1	418,1	325,3	616,6
ii. A futuro	98,0	130,0	110,0	70,0	88,0
e. Operaciones sod asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	142,1	164,2	126,8	61,4	35,1
i. Compras	248,2	588,3	467,8	242,9	559,5
ii. (-) Ventas	106,1	424,0	341,0	181,5	524,4
f. Efecto de Coclones	0,1	0,3	-19,4	-4,8	-0,7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	72,7	-11,7	9,1	0,4	-14,4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,8443	3,8333	3,8287	3,8380	3,8462
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera