BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	16 Ene 23	17 Ene 23	18 Ene 23	19 Ene 23	20 Ene 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	7 786,2	7 425,9	7 399,7	6 398,3	5 916,8
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias efectuadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	13 138,4	13 138,4	13 138,4	13 138,4	13 138,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 20 de Febrero del 2023	1 550,4	1 550,4	1 550,4	1 550,4	1 550,4
Vencimiento de CD BCRP del 23 al 27 de enero de 2023	0,0		0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					350,0
Propuestas recibidas					350,0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					8,66
Máxima					8,70
Promedio					8,68
Saldo	9 248,4	9 248,4	9 248,4	8 948,4	9 248,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 30 de Enero del 2023	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Repo Valores del 23 al 27 de enero de 2023	300,0	300,0	300,0		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 23 al 27 de enero de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 341,7	6 341,7	6 341,7	6 341,7	6 341,7
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Marzo del 2023	1,2	1,2	1,2	1,2	1,2
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 23 al 27 de enero de 2023	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 23 al 27 de enero de 2023					
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		0,0			0,0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez		0,0			0,0
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 23 al 27 de enero de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	200,0 40,0	300,0 2,0	300,0	300,0 102,2	300,0
Propuestas recibidas	625,0 40,0	580,0 2,0	550,0	595,0 102,2	440,0
Plazo de vencimiento	91 d 91 d	90 d 90 d	89 d	88 d 88 d	91 d
Margen: Mínima	-0,09 -0,08	-0,10 -0,08	-0,09	-0,11 -0,09	-0,94
Máxima	-0,08 -0,08	-0,08 -0,08	-0,09	-0,09 -0,09	-0,09
Promedio	-0,08 -0,08	-0,08 -0,08	-0,09	-0,09 -0,09	-0,17
Saldo	15 361,2	15 663,2	15 363,2	15 863,2	16 163,1
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 25 de Enero del 2023	500,1	500,1	500,1	1 500,0	1 500,0
Vencimientos de CDV BCRP del 23 al 27 de enero de 2023	500,1	500,1	500,1		2 400,0
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 23 al 27 de enero de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 599,9	3 900,1	500,0 3 400,0	3 700,0	500,0 4 000,0
Propuestas recibidas	3 796,6	4 231,0	610,0 4 277,0	4 540,0	637,0 4 142,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	7 d 1 d	1 d	7 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	6,00	6,50	7,37 6,60	7,00	7,69 7,30
Máxima	7,75	7,75	7,75 7,74	7,71	7,75 7,75
Promedio	7,41	7,63	7,72 7,59	7,61	7,74 7,61
Saldo	5 099,9	5 400,1	4 300,0	5 200,0	5 000,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 23 de Enero del 2023	3 599,9	4 400,1	3 400,0	4 700,0	4 000,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 23 al 27 de enero de 2023	5 099,9	5 400,1	4 400,0	4 700,0	5 000,0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 495,8	6 495,8	6 495,8	6 495,8	6 495,8
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de Febrero del 2023	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 23 al 27 de enero de 2023	0,0	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 23 al 27 de enero 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 del 23 al 27 de enero 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 del 23 al 27 de enero de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	792,0	792,0	792,0	792,0	792,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 24 de Marzo del 2023	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO del 23 al 27 de enero de 2023	0,0	0,0	0,0		0,0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de recompra					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso					
Vencimiento de REPO del 23 al 27 de enero 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 Repo Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 23 al 27 de enero 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 Repo Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 23 al 27 de enero de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200,0	50,0 200,0 300,0		200,0 50,0	
Propuestas recibidas	205,0	177,0 598,0 501,0		360,0 98,0	
Plazo de vencimiento	91 d	90 d 90 d 90 d		90 d 90 d	
Tasas de interés: Mínima	4,90	5,00 4,88 4,87		4,95 5,00	
Máxima	5,00	5,00 4,90 4,97		5,07 5,25	
Promedio	4,94	5,00 4,87 4,90		4,99 5,04	
Saldo	27 748,9	28 098,9	27 598,9	27 941,9	27 641,9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 24 de Enero del 2023	250,0	500,0	800,0	800,0	800,0
Vencimiento de SC - Venta del 23 al 27 de enero de 2023	750,0	500,0	0,0	0,0	3 136,9
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer Alliance (REA)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REO					
Vencimiento de REO del 23 al 27 de enero de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 040,0	2 010,0	2 010,0	1 960,0	1 960,0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 22 de Enero del 2023	30,0	50,0	50,0	100,0	100,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 20 al 27 de enero de 2023	80,0	50,0	50,0	0,0	80,0
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	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$)	3,9	0,0	0,0	61,9	3,5
i. Compras (millones de US$)	3,9	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	61,9	3,5
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valoriza)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	4 626,4	3 891,6	3 915,2	2 929,6	2 628,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0223%	0,0222%	0,0222%	0,0221%	0,0221%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	986,0	802,0	1 068,0	753,7	557,0
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4 326,4	3 386,6	2 791,3	2 175,9	1 461,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	15 032,9	14 375,1	14 479,6	14 216,1	13 945,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,6	8,2	7,3	7,2	7,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 823,0	7 589,4	7 270,3	7 004,1	6 734,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,0	4,3	3,7	3,5	3,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	905,9	996,8	797,4	1 040,0	879,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7,50 / 7,80 / 7,75	7,70 / 7,80 / 7,75	7,50 / 7,80 / 7,75	7,50 / 7,80 / 7,75	7,50 / 7,80 / 7,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	69,5	26,0	110,0	24,0	20,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	4,50 / 4,70 / 4,68	4,50 / 4,70 / 4,64	4,60 / 4,70 / 4,67	4,60 / 4,70 / 4,67	4,60 / 4,70 / 4,68
c. Total mercado secundario de COBCRP, COBCRP-NR y CDV					
Plazo hasta 1 mes o menos (monto / tasa promedio)					
Plazo hasta 3 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo hasta 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo hasta 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**Ene.13 2023**	**Ene.16 2023**	**Ene.17 2023**	**Ene.18 2023**	**Ene.19 2023**
Flujo de la posición global = a + b.1 - c.1 + e + f + g	50,6	76,2	40,8	25,9	33,9
Flujo de la posición contable = a + b.1 - c.1 + e + g	90,8	55,2	109,0	56,6	258,7
a. Mercado spot con el público	94,5	31,9	119,4	26,3	233,2
i. Compras	646,1	332,4	629,5	548,2	582,4
ii. (-) Ventas	551,6	280,5	710,2	572,5	352,3
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	337,6	9,6	-48,0	-9,3	-118,1
i. Pactadas	181,4	14,1	266,2	207,8	227,7
ii. (-) Vencidas	489,0	4,5	347,1	214,1	645,7
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	-178,5	37,6	99,5	30,2	-237,9
i. Pactadas	211,4	55,2	668,4	385,0	671,0
ii. (-) Vencidas	387,9	17,6	568,9	334,8	828,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	488,3	140,0	473,4	485,0	374,3
ii. A futuro	42,0	24,0	66,0	50,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-98,4	24,8	294,6	208,5	182,6
i. Compras	364,8	15,7	548,4	528,2	817,7
ii. (-) Ventas	463,2	0,9	343,9	119,7	635,1
f. Efecto de Posiciones	-3,8	-1,4	-3,6	9,3	-0,7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	5,1	23,8	77,3	-134,8	73,0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,8119	3,8275	3,8414	3,8327	3,8535

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera