BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	06 Feb 23	07 Feb 23	08 Feb 23	09 Feb 23	10 Feb 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	10 119,0	9 916,6	7 743,9	9 170,1	12 916,0
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	13 198,4	13 198,4	13 198,4	13 198,4	13 198,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 20 de Febrero del 2023	1 500,4	1 500,4	1 500,4	1 500,4	1 500,4
Vencimiento de CD BCRP del 13 al 17 de febrero de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	3000,0	1800,0			300,0
Propuestas recibidas	3575,0	3050,0			370,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d			91 d
Tasas de interés: Mínima	7,87	7,76			8,40
Máxima	7,98	7,85			8,45
Promedio	7,94	7,78			8,42
Saldo	11 848,4	9 348,4	6 348,4	6 348,4	6 648,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 13 de Febrero del 2023	2 500,0	1 000,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Repo Valores del 13 al 17 de febrero de 2023	3 500,0	1 000,0	0,0	0,0	300,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General					
Vencimiento de Repo de Cartera General del 13 al 17 de febrero 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	6 332,2
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Marzo del 2023				1,2	1,0
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 13 al 17 de febrero de 2023				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 13 al 17 de febrero 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	0,0	0,0	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez					
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 13 al 17 de febrero de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					300,0
Propuestas recibidas					850,0
Plazo de vencimiento					91 d
Margen: Mínima					-0,09
Máxima					-0,07
Promedio					-0,09
Saldo	15 415,3	15 415,3	15 415,3	15 415,3	15 115,3
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 17 de Febrero del 2023	1 509,8	1 509,8	1 509,8	1 509,8	1 509,8
Vencimientos de CDV BCRP del 13 al 17 de febrero de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	1 509,8
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 13 al 17 de febrero de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)			1 200,0	3 400,0	2 000,0 6 200,0
Propuestas recibidas			4 628,0	3 494,4	5 790,0 7 262,0
Plazo de vencimiento			1 d	1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima			6,45	6,60	6,80 6,10
Máxima			6,99	7,75	6,85 7,71
Promedio			6,77	7,30	6,83 7,11
Saldo	0,0	0,0	1 200,0	3 400,0	2 000,0 6 200,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 13 de Febrero del 2023			1 200,0	3 400,0	6 200,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 13 al 17 de febrero de 2023			1 200,0	3 400,0	6 200,0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 795,8	6 795,8	6 795,8	6 795,8	6 795,8
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 13 al 17 de febrero 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					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN del 13 al 17 de febrero 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	0,0	0,0	0,0	0,0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP					
Vencimiento de CDR BCRP del 13 al 17 de febrero 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 13 al 17 de febrero 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 13 al 17 de febrero de 2023	0,0	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 13 al 17 de febrero 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 13 al 17 de febrero 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 13 al 17 de febrero de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		200,0	200,0	200,0 200,0	
Propuestas recibidas		450,0	650,0	630,0 640,0	
Plazo de vencimiento		181 d	273 d	273 d 273 d	
Tasas de interés: Mínima		5,43	5,35	5,28 5,42	
Máxima		5,49	5,44	5,42 5,47	
Promedio		5,45	5,42	5,36 5,44	
Saldo	28 239,2	28 239,2	28 239,2	28 039,2	28 639,2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 14 de Febrero del 2023	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de SC - Venta del 13 al 17 de febrero de 2023	400,0	200,0	0,0	0,0	200,0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer millones (REAL)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	
Próximo vencimiento de REO					
Vencimiento de REO del 13 al 17 de febrero de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 600,0	1 570,0	1 570,0	1 520,0	1 520,0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 13 de Febrero del 2023	30,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 13 al 17 de febrero 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-B					
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$)	0,0	0,0	0,0	0,0	2,1
i. Compras (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	2,1
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valoriza)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	12 019,0	9 916,6	7 743,9	6 364,1	5 983,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0221%	0,0222%	0,0222%	0,0222%	0,0222%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	662,1	1 397,0	1 015,0	1 273,0	844,7
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	12 056,9	8 421,6	6 728,9	5 091,1	4 216,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	19 967,1	16 906,6	16 825,3	18 103,4	17 375,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,8	8,3	9,3	9,0	8,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	12 587,7	12 465,5	11 505,6	10 786,8	10 053,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,2	6,2	5,7	5,3	5,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	2 028,0	1 403,2	2 297,6	1 814,3	1 647,3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7,50 / 7,80 / 7,75	7,00 / 7,75 / 7,75	7,00 / 7,80 / 7,75	6,50 / 7,75 / 7,75	7,50 / 7,80 / 7,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	50,0	70,0	61,0	0,0	38,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	4,75 / 4,75 / 4,75	4,75 / 4,75 / 4,75	4,75 / 4,75 / 4,75	4,75 / 4,75 / 4,75	4,75 / 4,75 / 4,75
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$)	**Feb.03 2023**	**Feb.06 2023**	**Feb.07 2023**	**Feb.08 2023**	**Feb.09 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-30,7	-6,2	21,0	-0,7	39,0
Flujo de la posición contable = a + b.i - c.ii + e + g	92,5	-120,9	0,2	-21,6	-111,9
a. Mercado spot con el público	-39,1	-301,3	-29,8	-18,9	-99,0
i. Compras	647,4	904,7	505,6	384,4	741,5
ii. (-) Ventas	574,3	1206,0	535,4	404,2	840,4
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	86,8	116,2	-173,7	84,3	-199,9
i. Pactadas	156,9	172,4	291,2	270,8	224,5
ii. (-) Vencidas	72,1	56,2	374,9	186,5	424,4
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	106,4	1,4	-192,7	64,6	-238,4
i. Pactadas	204,0	126,1	195,6	342,7	402,9
ii. (-) Vencidas	95,6	125,7	388,3	278,1	641,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	617,6	344,9	397,7	383,3	383,6
ii. A futuro	4,0	0,0	10,0	40,0	54,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	52,5	28,4	38,8	97,7	213,9
i. Compras	93,7	111,8	380,9	267,1	637,1
ii. (-) Ventas	41,2	53,5	342,0	169,4	423,3
f. Efecto de Opciones	-0,9	-2,0	0,4	-5,8	-1,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-100,3	-7,5	0,0	2,0	93,6
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,8516	3,8548	3,8454	3,8570	3,8666

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera