BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	08 May 23	09 May 23	10 May 23	11 May 23	12 May 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**4 732.4**	**4 979.2**	**5 249.3**	**5 543.3**	**4 832.4**
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					1000.0 500.0
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCR)					1912.5 779.5
Procuestas recibidas					185 d 94 d
Plazo de vencimiento					7.50 7.45
Tasas de interés: Mínima					7.58 7.57
Máxima					7.54 7.57
Promedio					23 966.0
Saldo	22 466.0	22 466.0	22 466.0	22 466.0	1 839.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Mayo del 2023	750.0	750.0	750.0	750.0	2 949.0
Vencimiento de CD BCRP del 15 al 19 de mayo de 2023	750.0	750.0	750.0	750.0	1000.0 500.0 1200.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2000.0 300.0 500.0 2300.0	2000.0 2700.1	1500.0 2000.0	1000.0 200.0 1100.0	1950.0 400.0 555.0 1395.0
Procuestas recibidas	4765.0 950.0 900.0 3515.0	4820.0 4035.0	3990.0 2350.0	2720.0 500.0 1770.0	3 d 91 d 7 d 3 d
Plazo de vencimiento	1 d 92 d 35 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 92 d 1 d	7.87 8.05 8.01 7.85
Tasas de interés: Mínima	7.87 8.32 8.16 7.80	7.87 7.85	7.88 7.75	7.90 8.15 7.91	7.95 8.21 8.01 8.0
Máxima	7.90 8.42 8.26 7.89	7.90 7.91	7.93 7.91	7.92 8.25 7.93	7.93 8.17 8.01 7.93
Promedio	7.90 8.37 8.21 7.88	7.89 7.88	7.89 7.87	7.91 8.20 7.92	15 958.4
Saldo	19 958.4	18 958.3	18 958.4	15 958.4	2 900.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 15 de Mayo del 2023	5 500.0	5 500.1	4 000.0	2 900.0	3 600.0
Vencimiento de Reco Valores del 15 al 19 de mayo de 2023	7 100.0	6 500.1	4 800.0	2 900.0	
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0				
Próximo vencimiento de Reco de Cartera General					
Vencimiento de Reco de Cartera General del 15 al 19 de mayo de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 332.2	6 332.2	6 332.2	6 332.2	6 332.2
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo	3.7	3.7	3.7	3.7	3.7
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 15 al 19 de mayo de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Reactiva Garantía para los créditos					
Procuestas 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					
Procuestas 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)					
Procuestas 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 19 de mayo de 2023					
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Apoyo de Liquidez					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0				
Próximo vencimiento de Reco de Cartera para el Apoyo de Liquidez					
Vencimientos de Reco de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 15 al 19 de mayo de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 902.6	6 902.6	6 902.6	6 902.6	6 152.6
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 16 de Mayo del 2023	750.0	750.0	750.0	750.0	1 218.3
Vencimientos de CDV BCRP del 15 al 19 de mayo de 2023	750.0	750.0	750.0	750.0	1 966.3
x. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP					
Vencimiento de CDLD BCRP del 15 al 19 de mayo de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0				
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 15 al 19 de mayo de 2023					
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0	300.0	300.0		
Procuestas recibidas	577.8	483.1	421.0		
Plazo de vencimiento	184 d	194 d	184 d		
Tasas de interés: Mínima	8.38	8.18	7.96		
Máxima	8.55	8.58	8.36		
Promedio	8.46	8.34	8.13		
Saldo	6 729.7	6 729.7	6 834.2	6 834.2	6 834.2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 15 de Mayo del 2023	300.0	195.5	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 15 al 19 de mayo de 2023	495.5	195.5	0.0	0.0	800.0
xiii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN del 15 al 19 de mayo de 2023					
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	60.0	60.0	60.0	60.0	60.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	60.0	60.0	60.0	60.0	60.0
Vencimiento de CDR BCRP del 15 al 19 de mayo de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 15 al 19 de mayo de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reducir)				200.0	300.0
Procuestas recibidas				700.0	440.0
Plazo de vencimiento				93 d	91 d
Tasas de interés: Mínima				8.16	7.90
Máxima				8.18	8.16
Promedio				8.11	7.86
Saldo	782.0	782.0	782.0	982.0	1 282.0
Próximo vencimiento de Reco Recular el 17 de Mayo del 2023	27.0	27.0	27.0	27.0	27.0
Vencimiento de REPO del 15 al 19 de mayo de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	85.0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco					
Vencimiento de REPO del 15 al 19 de mayo de 2023					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 15 al 19 de mayo de 2023					
xix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 15 al 19 de mayo de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				10.0 200.0	200.0 200.0
Procuestas recibidas				990.0 890.0	680.0 510.0
Plazo de vencimiento				183 d 365 d	185 d 185 d
Tasas de interés: Mínima				5.75 5.55	5.73 5.63
Máxima				5.75 5.59	5.73 5.69
Promedio				5.75 5.57	5.73 5.67
Saldo	34 191.2	34 191.2	34 191.2	34 201.2	34 071.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 15 de Mayo del 2023	200.0	200.0	200.0	530.0	200.0
Vencimiento de SC - Venta del 15 al 19 de mayo de 2023	730.0	730.0	730.0	530.0	850.0
xxi. Subasta de Reco de Valores cara onower dólares (REDI)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0				
Próximo vencimiento de REDI					
Vencimiento de REDI del 15 al 19 de mayo de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	545.0	545.0	545.0	545.0	525.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 15 de Mayo del 2023	20.0	20.0	20.0	20.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 15 al 19 de mayo de 2023	20.0	20.0	20.0	20.0	60.0
b. Local. Reros 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$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.2	29.1	0.8	0.5	-108.0
i. Compras (millones de US$)	0.2	29.1	0.8	0.5	0.1
ii. Ventas (millones de US$)					108.1
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	50.3	0.0	96.8	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	50.3	0.0	96.8	0.0	0.0
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**10 115.4**	**9 915.3**	**9 949.3**	**9 943.3**	**6 985.3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	86.0	26.0	34.0	103.3	83.0
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**10 029.4**	**9 993.3**	**9 915.3**	**7 940.0**	**6 902.3**
e. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	17 004.6	16 986.1	17 014.7	16 898.5	16 889.6
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio requerido (%)	8.4	8.5	8.5	8.5	8.5
g. Fuente restante moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	9 626.9	9 471.5	9 500.0	9 376.1	9 566.0
h. Fuente restante moneda nacional promedio requerido (%) (*)	4.7	4.8	4.7	4.6	4.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	636.0	807.1	818.8	1 776.9	1 655.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	-	60.0	59.8	100.8	140.8
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	- / - / -	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25
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$)	**May.05 2023**	**May.08 2023**	**May.09 2023**	**May.10 2023**	**May.11 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	69.0	-22.9	-38.4	-15.4	98.7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + o	-41.8	-31.8	-81.9	-39.5	214.9
a. Mercado spot con el público	-38.2	-13.1	-84.7	-17.3	217.8
i. Compras	447.6	1001.0	328.7	416.3	628.1
ii. (-) Ventas	485.8	1014.1	413.4	433.6	410.3
b. Compras forward o swap al público (con v sin entrega)	158.7	-69.0	156.4	32.5	-221.2
i. Pactadas	300.9	359.1	208.5	169.0	391.3
ii. (-) Vencidas	142.2	428.1	52.1	136.4	612.5
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	27.8	-79.3	113.2	5.5	-105.1
i. Pactadas	268.1	427.3	279.7	171.6	595.1
ii. (-) Vencidas	240.4	506.7	166.6	166.1	700.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	309.7	273.5	370.9	467.3	353.7
ii. A futuro	40.0	63.0	44.0	91.0	0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	99.7	65.6	126.5	10.5	80.4
i. Compras	233.5	490.7	165.5	135.0	692.4
ii. (-) Ventas	133.8	425.1	37.0	124.5	612.0
f. Efecto de Opciones	3.1	0.4	0.3	-2.9	-0.1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-27.8	-37.6	-11.2	-3.1	4.4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7127	3.7046	3.6990	3.6700	3.6822
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera