BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	30 May 23	29 May 23	31 May 23	01 Jun 23	02 Jun 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**2 550,2**	**2 203,1**	**2 100,5**	**1 883,9**	**2 982,5**
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)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	26 618.1	26 618.1	26 618.1	26 618.1	26 478.1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Junio del 2023	140.0	140.0	140.0	140.0	600.0
Vencimiento de CD BCRP del 5 al 9 de lunio de 2023	140.0	140.0	140.0	140.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				6000.0 750.0 500.0 2100.0	5000.0 500.0 750.0 1740.0
Procuestas recibidas				8050.0 1800.0 1190.0 2100.0	5780.0 900.0 1060.0 1740.0
Plazo de vencimiento				1 d 32 d 7 d 1 d	3 d 91 d 31 d 3 d
Tasas de interés: Mínima				7.83 8.15 8.10 7.75	7.80 8.26 8.0 7.75
Máxima				8.75 8.45 8.10 7.90	8.15 8.38 8.30 7.77
Promedio				8.0 8.25 8.10 7.84	7.91 8.32 8.11 7.76
Saldo	13 358.4	13 358.4	13 358.4	22 208.4	21 598.4
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 5 de Junio del 2023	500.0	500.0	500.0	8 600.0	7 240.0
Vencimiento de Reco Valores del 5 al 9 de lunio de 2023	1 000.0	1 000.0	1 000.0	8 600.0	9 540.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Procuestas 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 5 al 9 de junio 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 el 26 de Julio del 2023	3.7	3.7	3.7	3.7	
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 5 al 9 de lunio 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					
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 Reco Especial - CDR del 5 al 9 de lunio 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					
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez					
Vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 5 al 9 de junio de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDV BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 254.0	2 254.0	2 254.0	2 254.0	1 700.0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 9 de Junio del 2023	554.0	554.0	554.0	554.0	600.0
Vencimientos de CDV BCRP del 5 al 9 de lunio de 2023	554.0	554.0	554.0	554.0	600.0
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 5 al 9 de lunio de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 000.0	700.0	500.0		
Procuestas recibidas	1 751.2	1 148.7	1 524.8		
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d		
Tasas de interés: Mínima	6.80	7.00	6.50		
Máxima	7.10	7.25	6.75		
Promedio	7.00	7.10	6.60		
Saldo	1 000.0	700.0	500.0		
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	1 000.0	700.0	500.0		
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 5 al 9 de lunio de 2023	1 000.0	700.0	500.0		
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)		136.9			500.0
Procuestas recibidas		176.9			608.1
Plazo de vencimiento		184 d			185 d
Tasas de interés: Mínima		8.05			7.86
Máxima		8.71			8.10
Promedio		8.25			8.00
Saldo	6 661.6	6 661.6	6 661.6	6 661.6	6 861.6
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 5 de Junio del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 5 al 9 de lunio de 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
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 5 al 9 de lunio 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 el 13 de Julio del 2023	60.0	60.0	60.0	60.0	60.0
Vencimiento de CDR BCRP del 5 al 9 de lunio de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Neocotización Reatimada (CDBCRP-NR)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 5 al 9 de lunio de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				500.0	500.0
Procuestas recibidas				1143.0	986.0
Plazo de vencimiento				32 d	31 d
Tasas de interés: Mínima				8.30	8.10
Máxima				8.40	8.45
Promedio				8.38	8.27
Saldo	1 197.0	1 197.0	1 197.0	1 697.0	2 197.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 9 de lunio del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de REPO del 5 al 9 de lunio de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	300.0
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 5 al 9 de lunio 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 Reco Excansion					
Vencimiento de REPO Excansión del 5 al 9 de lunio 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 5 al 9 de junio de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			350.0	200.0 300.0 300.0 300.0 200.0	300.0 140.0 170.0
Procuestas recibidas			1090.0	1082.0 1210.0 1040.0 745.0 510.0	770.0 220.0 200.0
Plazo de vencimiento			183 d	183 d 274 d 274 d 277 d 368 d	367 d 367 d 368 d
Tasas de interés: Mínima			5.48	5.27 5.27 5.07 5.03	5.12 5.27 4.43
Máxima			5.54	5.27 5.31 5.07 5.20 5.13	5.14 5.44 5.44
Promedio			5.49	5.27 5.29 5.07 5.13 5.10	5.13 5.32 5.17
Saldo	34 376.3	34 376.3	34 226.3	34 826.3	34 636.3
Próximo vencimiento de SC-Venta el 6 de Junio del 2023	400.0	400.0	700.0	800.0	360.0
Vencimiento de SC - Venta del 5 al 9 de lunio de 2023	1 900.0	1 900.0	1 500.0	800.0	1 080.0
xxi. Subasta de Reco de Valores sara orower dólares (RED)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 5 al 9 de lunio de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés			0.0		
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	420.0	420.0	420.0	420.0	390.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 6 de Junio del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 5 al 9 de lunio de 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	60.0
b. Usual. 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	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
i. Compras (millones de US$)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
Tipo de cambio promedio	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
ii. Ventas (millones de US$)	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$)	2.2	0.2	13.8	0.0	12.5
i. Compras (millones de US$)	2.2	0.2	13.8	0.0	12.5
ii. Ventas (millones de US$)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRPNR y NTP	0.0	47.6	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Vabrizado)	0.0	47.6	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**1 938,2**	**2 874,2**	**1 836,5**	**11 663,9**	**11 874,5**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por reajustación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 069.0	1 152.0	1 236.7	100.2	300.0
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**969,2**	**922,2**	**884,5**	**11 663,7**	**11 574,5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 493.6	12 760.5	12 480.9	12 336.1	18 742.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.5	6.2	6.1	6.0	9.3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 096.1	5 237.9	4 958.1	4 813.4	11 563.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.7	2.6	2.4	2.4	5.7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 194.3	1 267.7	716.2	580.0	845.2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.50 / 7.75 / 7.73
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	-	-	-	11.0	39.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	- / - / -	- / - / -	- / - / -	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRPNR y BTP					
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.29 2023**	**May.26 2023**	**May.30 2023**	**May.31 2023**	**Jun.01 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	5.7	23.2	49.8	24.1	112.1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	5.6	-74.2	87.8	-16.8	-13.9
a. Mercado spot con el público	16.3	-52.0	121.0	-2.6	9.6
i. Compras	239.8	488.1	488.4	780.8	516.3
ii. (-) Ventas	224.4	541.1	367.2	783.4	500.8
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	16.6	-2.5	87.4	300.7	-298.5
i. Pactadas	31.2	454.9	229.2	461.4	255.1
ii. (-) Vencidas	14.6	457.3	141.8	160.7	553.6
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	16.4	-122.1	124.4	219.0	-257.0
i. Pactadas	42.7	928.0	364.7	581.5	702.3
ii. (-) Vencidas	26.3	1050.1	240.3	362.5	1049.9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	194.0	372.3	677.9	409.3	316.8
ii. A futuro	29.2	20.0	100.0	85.0	63.0
e. Operaciones sool asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	2.9	576.9	68.2	194.6	464.8
i. Compras	10.5	1032.1	207.5	346.4	1016.9
ii. (-) Ventas	7.6	456.1	139.3	151.8	552.2
f. Efecto de Opciones	-0.1	4.0	-1.1	-0.9	-2.8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0.9	-32.7	-3.1	-47.0	177.7
h. Crédito por reajustación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6758	3.6672	3.6734	3.6793	3.6790
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera