BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	03 Jul 23	04 Jul 23	05 Jul 23	06 Jul 23	07 Jul 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 245,1	2 575,5	4 892,3	5 304,8	5 191,5
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)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	20 349,9	20 349,9	20 349,9	20 349,9	20 349,9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Julio del 2023	872,1	872,1	872,1	872,1	872,1
Vencimiento de CD BCRP del 10 al 14 de julio de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	872,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	4000,0 1000,0 2160,0	6000,0 750,0 2601,0	4000,0 1000,0 2600,0	4000,0 1000,0 2500,0	4000,0 600,0 2710,0
Propuestas recibidas	6300,0 1695,0 2160,0	7270,0 1050,0 2601,0	7240,0 1600,0 3270,0	6710,0 1955,0 3950,0	5760,0 1330,0 2710,0
Plazo de vencimiento	1 d 30 d 1 d	1 d 31 d 1 d	1 d 33 d 1 d	1 d 33 d 1 d	3 d 91 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	7,85 7,96 7,75	7,76 7,86 7,75	7,78 7,91 7,75	7,78 7,88 7,76	7,79 8,34 7,76
Máxima	8,03 8,30 8,16	8,10 7,96 8,0	8,05 8,0 8,12	8,12 8,05 7,85	7,90 8,45 7,83
Promedio	7,93 8,26 7,91	7,94 7,92 7,81	7,92 7,99 7,80	7,89 7,99 7,84	7,85 8,39 7,79
Saldo	27 849,4	27 099,4	27 609,4	27 609,4	27 609,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 10 de Julio del 2023	7 696,0	6 101,0	6 300,0	7 300,0	7 010,0
Vencimiento de Repo Valores del 10 al 14 de julio de 2023	9 460,0	10 461,0	6 160,0	7 300,0	7 810,0
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 10 al 14 de julio de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 305,8	6 305,8	6 305,8	6 305,8	6 305,8
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 26 de Julio del 2023	2,5	2,5	2,5	2,5	2,5
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 10 al 14 de julio 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 (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 10 al 14 de julio 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					
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez					
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 10 al 14 de julio de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Márgen: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 10 al 14 de julio de 2023					
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 10 al 14 de julio de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	300,0				
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	300,0				
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 10 al 14 de julio de 2023	300,0				
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCETP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7 044,3	7 044,3	7 044,3	7 044,3	7 044,3
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Julio del 2023	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 10 al 14 de julio 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 10 al 14 de julio 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	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 10 al 14 de julio de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	60,0
xv. Subasta de Certificados de Depósito 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 10 al 14 de julio de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	60,0	1000,0	200,0	200,1	
Propuestas recibidas	260,0	1388,0	1510,0	650,0	
Plazo de vencimiento	30 d	31 d	33 d	33 d	
Tasas de interés: Mínima	8,05	8,05	8,08	8,12	
Máxima	8,21	8,10	8,15	8,12	
Promedio	8,13	8,05	8,11	8,12	
Saldo	807,6	1 807,6	2 307,6	2 407,1	2 207,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 2 de Agosto del 2023	200,0	200,0	200,0	200,1	60,0
Vencimiento de REPO del 10 al 14 de julio de 2023	400,0	400,0	400,0	200,0	0,0
xvii. Venta de moneda extranjera con concurrencia de rueda					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco					
Vencimiento de REPO del 10 al 14 de julio 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 10 al 14 de julio 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 10 al 14 de julio de 2023					
xx. Compra de Swap Cambiario Venta del BCRP	200,0 300,0 300,0				
Propuestas recibidas	750,0 940,0 750,0				
Plazo de vencimiento	366 d 184 d 275 d				
Tasas de interés: Mínima	5,35 5,37 5,30				
Máxima	5,40 5,39 5,41				
Promedio	5,38 5,38 5,35				
Saldo	32 491,2	32 491,2	32 491,2	32 491,2	32 491,2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 20 de Julio del 2023	40,0	40,0	40,0	40,0	40,0
Vencimiento de SC - Venta del 10 al 14 de julio de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xxi. Subasta de Repo de Valores para enviar dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 10 al 14 de julio de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	210,0	210,0	210,0	210,0	380,0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 14 de Julio del 2023	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 10 al 14 de julio de 2023	30,0	30,0	30,0	30,0	30,0
b. Liquid. Pagos 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$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US$)	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$)	0,0	0,2	1,2	10,4	0,1
i. Compras (millones de US$)	0,0	0,2	1,2	10,4	0,1
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	21,3	0,0	49,9	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	21,3	0,0	49,9	0,0	0,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**9 485,1**	**12 926,5**	**13 360,9**	**13 099,9**	**12 501,5**
4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	0,0221%	0,0221%	0,0221%	0,0221%	0,0221%
Tasa de interés anual (Base 360)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	18,5	18,9	29,6	25,0	389,0
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**9 456,6**	**12 907,6**	**13 331,3**	**13 074,9**	**12 112,5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	11 946,3	12 467,9	14 019,9	15 617,4	16 206,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,9	6,1	7,2	7,7	8,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 783,1	5 618,8	7 770,7	8 768,3	9 347,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,4	2,8	3,8	4,3	4,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	428,0	681,7	695,5	670,3	363,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7,75 / 8,00 / 7,81	7,75 / 7,75 / 7,75	7,75 / 7,75 / 7,75	7,75 / 7,75 / 7,75	7,75 / 7,75 / 7,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	13,0	33,0	13,0	6,0	6,0
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	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$)	**Jun.30 2023**	**Jul.03 2023**	**Jul.04 2023**	**Jul.05 2023**	**Jul.06 2023**
Flujo de la posición global = a + b + c + d + e + f + g	1,7	57,4	40,5	-31,0	-197,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	203,0	120,3	35,5	30,7	33,8
a. Mercado spot con el público	292,6	353,4	46,4	34,6	37,3
i. Compras	1467,4	767,7	232,7	731,0	852,4
ii. (-) Ventas	1265,4	616,4	186,3	696,2	845,1
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-149,4	-119,7	60,0	254,1	-129,9
i. Pactadas	251,1	79,4	81,1	323,5	315,7
ii. (-) Vencidas	391,6	198,1	1,1	69,4	439,6
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-38,1	49,2	74,0	315,1	37,3
i. Pactadas	713,7	465,2	106,8	1008,1	963,6
ii. (-) Vencidas	752,4	412,0	31,8	694,0	526,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	398,1	376,2	172,0	425,5	696,1
ii. A futuro	160,0	112,0	160,0	253,0	106,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	361,9	184,1	30,4	623,8	80,9
i. Compras	747,7	375,3	31,1	660,0	509,5
ii. (-) Ventas	385,8	191,2	0,6	69,2	428,6
f. Efecto de Opciones	0,0	2,1	-0,6	-0,6	0,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-100,6	89,7	-10,7	-3,2	2,1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,6267	3,6258	3,6281	3,6304	3,6460
(*) Cifras preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera