BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	10 Jul 23	11 Jul 23	12 Jul 23	13 Jul 23	14 Jul 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**7 231,6**	**8 099,0**	**8 709,3**	**8 893,0**	**7 216,6**
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)				500.0	500.0
Propuestas recibidas				1293.0	1237.0
Plazo de vencimiento				186 d	185 d
Tasas de interés: Mínima				7.18	7.10
Máxima				7.18	7.23
Promedio				7.18	7.18
Saldo	29 477.8	29 477.8	29 477.8	30 026.8	30 571.8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 17 de Julio del 2023	1 071.8	1 071.8	1 071.8	1 071.8	1 071.8
Vencimiento de CD BCRP del 17 al 21 de julio de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	1 071.8
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	3000.0 2000.0	1000.0 1800.0			600.0
Propuestas recibidas	3810.0 2555.0	3550.0 3700.0			1500.0
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d			91 d
Tasas de interés: Mínima	7.75 7.75	7.85 7.80			8.32
Máxima	7.95 7.77	7.90 7.85			8.41
Promedio	7.83 7.75	7.88 7.82			8.37
Saldo	20 008.4	17 808.4	15 008.4	14 708.4	14 808.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de Julio del 2023	5 000.0	2 800.0	300.0	500.0	505.0
Vencimiento de Repo Valores del 17 al 21 de julio de 2023	5 800.0	3 600.0	800.0	500.0	505.0
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 17 al 21 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 17 al 21 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 17 al 21 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 17 al 21 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 17 al 21 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 17 al 21 de julio de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)				1 191.7	1 800.0
Propuestas recibidas				1 191.7	2 212.2
Plazo de vencimiento				1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima				6.25	6.48
Máxima				7.75	7.74
Promedio				7.27	7.44
Saldo				1 191.7	1 800.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de Julio del 2023				1 191.7	1 800.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 17 al 21 de julio de 2023				1 191.7	1 800.0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	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 17 al 21 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 17 al 21 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		
Próximo vencimiento de CDR BCRP	60.0	60.0	60.0		
Vencimiento de CDR BCRP del 17 al 21 de julio de 2023	60.0	60.0	60.0		
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 17 al 21 de julio de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 257.1	2 257.1	2 257.1	2 257.1	2 257.1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 2 de Agosto del 2023	60.0	60.0	60.0	60.0	60.0
Vencimiento de REPO del 17 al 21 de julio de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo					
Vencimiento de REPO del 17 al 21 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 Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 17 al 21 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 Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 17 al 21 de julio de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	32 451.2	32 451.2	32 451.2	32 451.2	32 451.2
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 17 al 21 de julio de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	740.0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 17 al 21 de julio de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	180.0	180.0	180.0	180.0	150.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 21 de Julio del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 17 al 21 de julio de 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
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$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	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$)	0.2	2.0	1.1	0.0	17.1
i. Compras (millones de US$)	0.2	2.0	1.1	0.0	17.1
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	52.4	0.0	50.5	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	52.4	0.0	50.5	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**12 231.6**	**10 899.0**	**8 709.3**	**7 648.0**	**6 008.7**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 255.1	1 851.0	1 137.0	835.0	358.0
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**10 976,5**	**9 048,0**	**7 572,3**	**6 813,0**	**5 650,7**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	17 019.1	16 979.9	16 729.9	16 438.1	16 185.5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8.4	8.3	8.2	8.1	7.9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	10 160.5	10 113.2	9 863.7	9 574.0	9 322.5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.0	5.0	4.8	4.7	4.6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	753.0	1 489.0	1 180.5	1 396.4	1 339.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.60 / 7.75 / 7.74	7.50 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	65.0	71.0	71.0	73.0	59.0
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$)	**Jul.07 2023**	**Jul.10 2023**	**Jul.11 2023**	**Jul.12 2023**	**Jul.13 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-30.2	-31.3	180.8	-120.2	34.8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-54,4	2,8	-112,3	-44,6	-210,7
a. Mercado spot con el público	-39,1	18,6	-108,6	-35,4	-194,2
i. Compras	475,7	778,0	338,4	703,6	452,7
ii. (-) Ventas	514,8	759,4	447,0	739,0	646,9
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	83,3	-201,9	288,4	-137,7	-234,9
i. Pactadas	144,5	152,5	379,4	204,0	345,4
ii. (-) Vencidas	61,2	354,4	91,0	341,7	580,3
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	55,7	-165,0	-4,7	-46,7	-468,9
i. Pactadas	171,7	176,0	263,4	411,9	565,2
ii. (-) Vencidas	116,1	341,0	268,1	458,6	1034,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	296,8	345,6	528,4	242,9	397,4
ii. A futuro	116,0	7,0	10,0	174,0	105,5
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	50,2	-29,7	176,9	115,5	459,2
i. Compras	111,2	324,0	261,5	455,8	1029,0
ii. (-) Ventas	60,9	353,6	84,6	340,4	569,9
f. Efecto de Opciones	-3,4	2,8	0,0	15,5	11,5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-10,7	0,4	-3,4	-7,8	-21,9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6393	3.6399	3.6335	3.5877	3.5661
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera