BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	21 Ago 23	22 Ago 23	23 Ago 23	24 Ago 23	25 Ago 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**9 592,2**	**8 453,1**	**7 547,1**	**7 708,3**	**6 482,6**
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	300.0 200.0		200.0	200.0
Procuestas recibidas	1115.0	449.7 365.0		541.0	355.0
Plazo de vencimiento	182 d	184 d 31 d		182 d	181 d
Tasas de interés: Mínima	7.17	7.14 7.69		7.16	7.16
Máxima	7.18	7.18 7.75		7.17	7.17
Promedio	7.18	7.17 7.74		7.16	7.17
Saldo	32 251.7	32 751.7	32 751.7	32 856.7	33 056.7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 1 de Setiembre del 2023	150.0	150.0	150.0	150.0	150.0
Vencimiento de CD BCRP del 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023	150.0	150.0	150.0	0.0	150.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					600.0
Procuestas recibidas					950.0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					7.85
Máxima					8.01
Promedio					7.94
Saldo	15 103.4	15 103.4	15 103.4	15 103.4	15 203.4
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 1 de Setiembre del 2023	500.0	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de Reco Valores del 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023	500.0	500.0	500.0	500.0	500.0
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 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 303.4	6 303.4	6 303.4	6 303.4	6 303.4
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 31 de Agosto del 2023	1.7	1.7	1.7	1.7	1.7
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	1.7
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 28 de agosto al 1 de setiembre 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 Reco de Cartera para el Apoyo de Liquidez					
Vencimiento de Reco de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDV BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023					
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 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	4 000.1 1 885.5	4 000.0 2 500.0	3 000.1 3 400.0	3 000.0 3 884.0	3 000.1 3 100.0
Procuestas recibidas	4 946.7 1 885.5	4 057.7 2 587.0	4 367.7 3 493.5	3 876.6 3 884.0	4 168.7 3 308.4
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	7.68 7.59	7.68 7.49	7.68 7.60	7.65 7.62	7.65 7.65
Máxima	7.72 7.71	7.75 7.75	7.73 7.75	7.72 7.75	7.72 7.74
Promedio	7.70 7.67	7.71 7.68	7.71 7.70	7.71 7.70	7.70 7.69
Saldo	5 885.6	6 500.0	6 400.1	6 884.0	6 100.1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 28 de Agosto del 2023	5 885.6	6 500.0	6 400.1	6 684.0	6 100.1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023	5 885.6	6 500.0	6 400.1	6 684.0	6 100.1
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0			100.0	
Procuestas recibidas	529.5			244.8	
Plazo de vencimiento	182 d			182 d	
Tasas de interés: Mínima	7.76			7.60	
Máxima	8.25			7.93	
Promedio	7.90			7.83	
Saldo	7 044.4	6 744.4	6 744.4	6 844.4	6 844.4
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 28 de Agosto del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023	300.0	0.0	0.0	0.0	600.0
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 28 de agosto al 1 de setiembre 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	280.0	280.0	280.0	280.0	280.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 3 de Noviembre del 2023	130.0	130.0	130.0	130.0	130.0
Vencimiento de CDR BCRP del 28 de agosto al 1 de setiembre 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 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 697.0	1 697.0	1 697.0	1 697.0	1 697.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 4 de Setiembre del 2023	500.0	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de REPO del 28 de agosto al 1 de setiembre 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 Reco					
Vencimiento de REPO del 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Excepción)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Excepcion					
Vencimiento de REPO Excepción del 28 de agosto al 1 de setiembre 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 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0	200.1	200.0		200.0
Procuestas recibidas	543.6	650.0	630.0		610.0
Plazo de vencimiento	184 d	184 d	184 d		185 d
Tasas de interés: Mínima	5.42	5.39	5.52		5.36
Máxima	5.43	5.50	5.55		5.54
Promedio	5.42	5.45	5.54		5.51
Saldo	35 021.1	35 221.2	35 221.2	35 221.2	35 021.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 29 de Agosto del 2023	200.0	200.0	400.0	400.0	500.0
Vencimiento de SC - Venta del 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023	600.0	600.0	400.0	400.0	1 100.0
xxi. Subasta de Reco de Valores sans crowver dólares (RED)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
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 Swap Tasas de Interés el 2 de Setiembre del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 28 de agosto al 1 de setiembre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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$)	0.5	1.6	0.3	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.5	1.6	0.3	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRPSUB y RTP	65.2	0.0	46.8	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	65.2	0.0	46.8	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 414,1**	**2 936,0**	**2 107,4**	**1 964,4**	**1 717,7**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	738.0	254.0	615.0	615.0	551.0
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**5 976,1**	**3 262,0**	**2 722,4**	**2 579,4**	**2 168,7**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	14 633.6	14 481.6	14 193.1	13 920.9	13 692.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.0	7.0	6.8	6.7	6.6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 675.2	7 523.2	7 234.7	6 962.6	6 733.9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.7	3.6	3.5	3.4	3.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	518.0	584.0	471.9	541.0	392.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	95.0	126.0	111.0	104.0	101.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50
c. Total mercado secundario de (*)CBTP (*)CBSUB y (*)TU					
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$)	**Ago.18 2023**	**Ago.21 2023**	**Ago.22 2023**	**Ago.23 2023**	**Ago.24 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + o	-37.7	-22.0	105.1	0.0	3.9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + o	-31.9	-42.8	6.9	-104.2	-186.9
a. Mercado spot con el público	-41.6	-5.2	30.9	-95.8	-177.4
i. Compras	366.2	765.9	433.7	332.8	760.3
ii. (-) Ventas	407.8	771.1	402.8	428.6	937.6
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	194.2	33.3	83.9	-8.9	-263.7
i. Pactadas	228.9	52.4	440.2	210.5	196.2
ii. (-) Vencidas	44.7	19.1	356.3	217.4	459.8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	191.9	66.2	36.7	-107.9	-451.2
i. Pactadas	258.3	193.7	546.7	572.9	327.5
ii. (-) Vencidas	66.4	127.4	510.0	680.7	778.7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	347.7	214.7	480.3	347.3	539.2
ii. A futuro	70.0	60.0	67.0	150.0	84.0
e. Operaciones sod asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	32.5	69.2	137.6	455.1	312.8
i. Compras	45.5	86.2	492.6	672.1	763.4
ii. (-) Ventas	13.0	17.0	355.0	217.0	450.7
f. Efecto de Opciones	2.0	-0.1	-2.1	2.0	3.2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-1.1	55.3	45.7	1.8	-3.5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7151	3.7198	3.7290	3.7103	3.6974
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera