BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	18 Dic 23	19 Dic 23	20 Dic 23	21 Dic 23	22 Dic 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**9 847,0**	**9 096,4**	**8 210,5**	**7 305,1**	**4 082,6**
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)	300.0 200.0	500.0 300.1	500.0	500.0 200.0	500.0
Procuestas recibidas	1025.0 720.0	1425.0 835.0	2075.0	1456.0 525.0	1370.0
Plazo de vencimiento	179 d 364 d	182 d 363 d	182 d	181 d 363 d	185 d
Tasas de interés: Mínima	6.60 6.46	6.58 6.48	6.58	6.58 6.48	6.58
Máxima	6.60 6.48	6.60 6.48	6.60	6.58 6.48	6.58
Promedio	6.60 6.48	6.60 6.48	6.60	6.58 6.48	6.58
Saldo	10 227.1	10 327.1	10 327.1	10 227.1	10 377.1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de Enero del 2024	1 322.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de CD BCRP del 26 al 29 de diciembre de 2023	1 322.0				0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					500.0
Procuestas recibidas					790.0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					6.73
Máxima					6.76
Promedio					6.75
Saldo	10 227.1	10 227.1	10 227.1	10 227.1	10 377.1
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 26 de Diciembre del 2023	350.0	350.0	350.0	350.0	245.0
Vencimiento de Reco Valores del 26 al 29 de diciembre de 2023	350.0	350.0	350.0	350.0	845.0
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 Reco de Cartera General					
Vencimiento de Reco de Cartera General del 26 al 29 de diciembre de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 264.6	6 264.6	6 264.6	6 264.6	6 264.6
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 3 de Enero del 2024	7.1	7.1	7.1	7.1	7.1
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 26 al 29 de diciembre de 2023					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 Reco Especial - CDR del 26 al 29 de diciembre 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					
Vencimientos de Reco de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 26 al 29 de diciembre de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 26 al 29 de diciembre 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 26 al 29 de diciembre de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 400.0	1 500.0 1 100.0	2 000.0 1 700.0	2 000.0 1 400.0	1 500.0 1 118.8
Procuestas recibidas	4 130.5	2 724.0 2 830.9	2 942.0 3 446.4	2 686.5 1 841.3	2 053.2 1 118.8
Plazo de vencimiento	1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	4 d 4 d
Tasas de interés: Mínima	6.18	6.11 6.05	6.10 5.97	6.10 5.95	6.05 5.95
Máxima	6.20	6.53 6.15	6.49 6.10	6.32 6.37	6.48 6.75
Promedio	6.20	6.35 6.12	6.32 6.07	6.27 6.08	6.28 6.34
Saldo	1 400.0	2 600.0	3 700.0	3 400.0	2 618.8
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 26 de Diciembre del 2023	1 400.0	2 600.0	3 700.0	3 400.0	2 618.8
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 26 al 29 de diciembre de 2023	1 400.0	2 600.0	3 700.0	3 400.0	2 618.8
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	221.0	300.0	300.0	300.1	200.0
Procuestas recibidas	706.0	980.2	858.9	461.2	672.6
Plazo de vencimiento	31 d	31 d	33 d	34 d	34 d
Tasas de interés: Mínima	6.80	6.81	6.83	6.85	6.86
Máxima	6.80	6.90	6.90	6.97	6.98
Promedio	6.80	6.81	6.84	6.94	6.96
Saldo	5 744.7	5 744.7	5 744.7	5 744.8	5 744.8
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Diciembre del 2023	300.0	300.0	300.0	200.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 26 al 29 de diciembre de 2023	1 100.0	800.0	500.0	200.0	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 26 al 29 de diciembre 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	1 828.0	1 828.0	1 828.0	1 528.0	1 528.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 26 de Diciembre del 2023	300.0	300.0	300.0	628.0	628.0
Vencimiento de CDR BCRP del 26 al 29 de diciembre de 2023	300.0	300.0	300.0		1 228.0
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 26 al 29 de diciembre de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	262.0	262.0	262.0	242.0	242.0
Próximo vencimiento de Reco Regular el 27 de Diciembre del 2023	20.0	20.0	20.0	15.0	15.0
Vencimiento de REPO del 26 al 29 de diciembre de 2023	20.0	20.0	20.0		15.0
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 26 al 29 de diciembre 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 Reco Excansion					
Vencimiento de REPO Excansión del 26 al 29 de diciembre 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 26 al 29 de diciembre de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				126.0 200.0 300.0	200.0 200.0 200.0
Procuestas recibidas				379.0 773.5 756.0	453.0 743.0 504.0
Plazo de vencimiento				91 d 278 d 278 d	277 d 367 d 367 d
Tasas de interés: Mínima				6.45 6.47 6.48	6.50 6.07 6.15
Máxima				6.45 6.45 6.48	6.50 6.17 6.15
Promedio				6.45 6.46 6.48	6.50 6.14 6.15
Saldo	44 974.8	44 974.8	44 974.8	45 100.8	45 065.8
Próximo vencimiento de SC-Venta el 27 de Diciembre del 2023	400.0	400.0	400.0	700.0	200.0
Vencimiento de SC - Venta del 26 al 29 de diciembre de 2023	1 100.0	1 100.0	1 100.0	700.0	1 200.0
xxi. Subasta de Reco de Valores sara orowser dólares (RED)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 26 al 29 de diciembre de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés					
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 26 al 29 de diciembre de 2023					
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	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$)	-9.5	1.3	2.3	17.0	3.9
i. Compras (millones de US$)	0.4	1.3	2.3	17.0	3.9
ii. Ventas (millones de US$)	9.9				
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP. CD BCRP-NR y BTP	90.0	0.0	117.3	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	90.0		117.3		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**7 718.3**	**6 445.1**	**4 969.4**	**4 627.1**	**2 695.5**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (repos).					
(Compras (tasa efectiva diaria)	0.0 0.0%	0.0 0.0%	0.0 0.0%	0.0 0.0%	0.0 0.0%
b. Compra temporal diaria de valores (tasa de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por reculación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	560.0	261.0	260.0	69.0	411.0
Tasa de interés	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**7 158.3**	**6 184.1**	**4 709.4**	**4 558.1**	**2 284.5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	15 419.4	15 313.8	15 141.5	14 891.6	14 717.6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.3	7.3	7.2	7.1	7.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 761.3	8 655.6	8 483.3	8 233.4	8 059.5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.2	4.1	4.0	3.9	3.8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	543.7	1 131.0	889.3	819.7	1 126.3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6.75 / 6.75 / 6.75	6.75 / 6.75 / 6.75	6.75 / 6.75 / 6.75	6.75 / 6.75 / 6.75	6.75 / 6.75 / 6.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	202.0	279.5	215.5	180.5	102.5
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 CDBCRP. CDBCRP-NR y CDV					
Plazo hasta 1 mes o menos (monto / tasa ponderado)					
Plazo hasta 6 meses (monto / tasa ponderado)					
Plazo hasta 12 meses (monto / tasa ponderado)					
Plazo hasta 24 meses (monto / tasa ponderado)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**Dic.15 2023**	**Dic.18 2023**	**Dic.19 2023**	**Dic.20 2023**	**Dic.21 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e.1 + o	-152.7	118.2	-72.9	69.6	162.7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-125.3	24.0	-215.7	-84.0	-83.5
a. Mercado spot con el público	-77.6	79.4	-199.3	-89.5	10.4
i. Compras	638.6	487.3	534.8	691.7	743.2
ii. (-) Ventas	716.2	407.8	734.1	781.2	732.8
b. Compras forward y swap al público (con v sin entrega)	250.3	-412.3	340.0	33.7	-77.9
i. Pactadas	317.0	186.1	515.9	301.1	594.3
ii. (-) Vencidas	66.7	598.4	166.9	267.5	672.2
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	229.9	-504.5	210.3	-116.8	-262.8
i. Pactadas	419.0	231.4	515.6	322.7	561.4
ii. (-) Vencidas	189.2	735.9	305.4	439.5	824.2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	262.4	399.4	564.6	363.4	618.7
ii. A futuro	42.0	35.0	50.0	38.0	160.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entregs	117.1	121.6	133.5	159.8	156.2
i. Compras	166.5	646.3	300.2	426.1	816.8
ii. (-) Ventas	49.4	524.8	166.7	266.4	660.6
f. Efecto de Opciones	0.8	1.9	4.0	3.2	0.4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-70.8	-39.5	-11.4	-2.3	-37.3
h. Crédito por reculación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7607	3.7442	3.7112	3.7045	3.7060
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera