BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	27 Mar 23	28 Mar 23	29 Mar 23	30 Mar 23	31 Mar 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**7 055,8**	**7 683,3**	**7 108,2**	**7 617,2**	**5 782,5**
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)	300,0	300,0	300,1	700,0	700,0
Propuestas recibidas	500,0	785,0	680,0	1810,0	1470,0
Plazo de vencimiento	182 d	181 d	188 d	187 d	196 d
Tasas de interés: Mínima	7,63	7,64	7,64	7,63	7,63
Máxima	7,65	7,64	7,64	7,63	7,64
Promedio	7,65	7,64	7,64	7,63	7,63
Saldo	15 525,0	16 095,0	16 545,1	17 389,1	18 080,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de Abril del 2023	450,0	450,0	450,0	450,0	450,0
Vencimiento de CD BCRP del 3 al 7 de abril de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	450,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					500,0
Propuestas recibidas					1800,0
Plazo de vencimiento					95 d
Tasas de interés: Mínima					8,63
Máxima					8,67
Promedio					8,66
Saldo	9 208,4	9 208,4	9 208,4	8 908,4	9 508,4
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 10 de Abril del 2023	300,0	300,0	300,0	400,0	100,0
Vencimiento de Repo Valores del 3 al 7 de abril de 2023	300,0	300,0	300,0	0,0	100,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0		0.0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General					
Vencimiento de Reco de Cartera General del 3 al 7 de abril de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 332,2	6 332,2	6 332,2	6 332,2	6 332,2
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo				3,7	
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 3 al 7 de abril de 2023				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 3 al 7 de abril 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	0.0	0.0	0.0		0.0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez					
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 3 al 7 de abril de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Márgen: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	15 635,4	13 935,4	13 935,4	12 929,2	12 929,2
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 12 de Abril del 2023	1 700,0	1 006,2	1 006,2	1 533,4	1 533,4
Vencimientos de CDV BCRP del 3 al 7 de abril de 2023	2 706,2	1 006,2	1 006,2	0,0	0,0
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 3 al 7 de abril de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 674,0 3 504,1	1 807,0 4 536,1	2 000,0 3 407,1	1 999,9 4 132,2	809,0 2 700,0
Propuestas recibidas	1 674,0 3 504,1	1 807,0 4 536,1	2 202,0 3 407,1	2 637,0 4 132,2	809,0 2 842,4
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	7,70 7,70	7,70 7,68	7,72 7,68	7,71 7,60	7,60 7,50
Máxima	7,75 7,75	7,75 7,75	7,75 7,75	7,75 7,75	7,75 7,74
Promedio	7,74 7,73	7,74 7,73	7,74 7,73	7,74 7,73	7,73 7,63
Saldo	5 178,1	6 343,1	5 407,1	6 132,1	3 509,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 31 de Marzo del 2023	5 178,1	6 343,1	5 407,1	6 132,1	3 509,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 3 al 7 de abril de 2023	5 178,1	6 343,1	5 407,1	6 132,1	3 509,0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 729,7	6 729,7	6 729,7	6 729,7	6 729,7
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 10 de Abril del 2023	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 3 al 7 de abril 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 3 al 7 de abril 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	0.0	0.0	0.0		0.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP					
Vencimiento de CDR BCRP del 3 al 7 de abril de 2023					
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 3 al 7 de abril de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	582,0	582,0	582,0	582,0	582,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 10 de Abril del 2023	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0
Vencimiento de REPO del 3 al 7 de abril 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 3 al 7 de abril 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 3 al 7 de abril 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 3 al 7 de abril de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200,0			200,0 200,0 130,0	200,0 200,0
Propuestas recibidas	740,0			715,0 591,0 380,0	539,0 461,0
Plazo de vencimiento	275 d			363 d 183 d 363 d	362 d 362 d
Tasas de interés: Mínima	5,50			5,45 5,52 5,45	5,47 5,47
Máxima	5,50			5,55 5,55 5,59	5,48 5,55
Promedio	5,50			5,53 5,54 5,52	5,48 5,50
Saldo	38 828,2	38 528,2	38 358,2	37 959,2	37 859,2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 31 de Marzo del 2023	300,0	300,0	929,0	500,0	700,0
Vencimiento de SC - Venta del 3 al 7 de abril de 2023	1 899,0	1 599,0	1 429,0	500,0	2 410,0
xxi. Subasta de Reco de Valores para proveer dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0		0,0
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 3 al 7 de abril de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	900,0	900,0	900,0	900,0	900,0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 1 de Abril del 2023	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 3 al 7 de abril de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	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$)	15,0	6,1	2,5	1,6	0,8
i. Compras (millones de US$)	15,0	6,1	2,5	1,6	0,8
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	93,7	0,0	63,0	94,0	94,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	93,7	0,0	63,0	94,0	94,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 513,0**	**2 023,3**	**2 393,2**	**1 946,2**	**3 129,5**
4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	0,0226%	0,0226%	0,0227%	0,0227%	0,0217%
Tasa de interés	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	605,0	360,0	927,0	962,9	512,7
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 908,0**	**1 663,3**	**1 466,2**	**983,3**	**2 616,8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (1)	12 807,5	12 890,6	12 547,7	12 409,4	12 255,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (1)	6,3	6,3	6,2	6,1	6,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 678,1	5 561,1	5 418,3	5 280,0	5 125,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (1)	2,8	2,8	2,7	2,6	2,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	713,0	721,4	608,9	376,3	442,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7,75 / 7,75 / 7,75	7,75 / 7,75 / 7,75	7,75 / 7,75 / 7,75	7,75 / 7,75 / 7,75	7,75 / 7,75 / 7,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	67,0	77,0	107,0	67,0	53,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00
c. Total mercado secundario de COBCRP, COBCRP-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$)	**Mar.24 2023**	**Mar.27 2023**	**Mar.28 2023**	**Mar.29 2023**	**Mar.30 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	22,3	3,8	-16,3	89,7	-53,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	127,0	57,8	150,2	-39,7	281,5
a. Mercado scot con el público	93,7	53,8	156,6	-32,3	282,4
i. Compras	665,0	407,8	508,9	413,5	750,0
ii. (-) Ventas	571,3	354,0	352,3	445,8	467,6
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	34,9	134,4	51,4	220,5	-377,3
i. Pactadas	124,1	196,1	163,5	605,4	102,4
ii. (-) Vencidas	89,2	61,7	112,1	384,9	479,7
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	139,5	194,1	141,7	66,0	-134,3
i. Pactadas	396,9	274,8	347,5	473,3	487,4
ii. (-) Vencidas	257,4	80,8	205,8	407,2	621,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	266,5	239,7	429,2	482,3	351,1
ii. A futuro	0,0	10,0	45,9	40,0	11,0
e. Operaciones scot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	206,0	25,2	96,5	23,9	138,7
i. Compras	249,6	77,5	204,4	396,9	613,1
ii. (-) Ventas	43,6	52,3	108,0	373,0	474,4
f. Efecto de Cociones	-0,1	0,1	-0,2	0,7	-0,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-4,6	3,4	-85,1	-54,7	-89,7
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,7707	3,7677	3,7652	3,7544	3,7581

(1) Datos preliminares

Publicación: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera