BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	03 Abr 23			04 Abr 23			05 Abr 23		
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**5 512,4**			**6 004,8**			**4 363,0**		
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	18 090,1			17 630,1			17 630,1		
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Abril del 2023	450,0			1 618,9			1 618,9		
Vencimiento de CD BCRP del 5 al 7 de abril de 2023	450,0			0,0			2 348,9		
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	3000,0	500,0	3600,1	3000,0	500,0	2800,0	3000,0	500,0	2700,0
Propuestas recibidas	5150,0	8300,0	7865,0	7560,1	1150,0	4945,0	6650,0	1100,0	5580,0
Plazo de vencimiento	1 d	30 d	1 d	1 d	30 d	1 d	5 d	91 d	5 d
Tasas de interés: Mínima	7,82	8,21	7,85	7,87	8,23	7,85	7,90	8,63	7,96
Máxima	7,90	8,37	7,90	7,92	8,41	7,95	7,95	8,71	7,99
Promedio	7,86	8,30	7,87	7,90	8,32	7,91	7,92	8,67	7,97
Saldo	16 508,5			16 208,4			16 658,4		
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 5 de Abril del 2023	6 600,1			5 800,0			6 150,0		
Vencimiento de Repo Valores del 5 al 7 de abril de 2023	6 600,1			5 800,0			6 150,0		
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					
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General									
Vencimiento de Reso de Cartera General del 5 al 7 de abril de 2023									
iv. Subasta de Compra Temporal de Carteras de Créditos (Alternativo)									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento									
Tasas de interés: Mínima									
Máxima									
Promedio									
Saldo	6 332,2			6 332,2			6 332,2		
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativo							3,7		
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 5 al 7 de abril de 2023							0,0		
v. Subasta de Compra Temporal de Carteras 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		
vi. Subasta de Compra Temporal de Carteras 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		
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 5 al 7 de abril de 2023									
viii. Subasta de Compra Temporal de Carteras de Créditos para el Apoyo de Liquidez									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento									
Tasas de interés: Mínima									
Máxima									
Promedio									
Saldo	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 5 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	12 929,2			12 929,2			12 929,2		
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 12 de Abril del 2023	1 533,4			1 533,4			1 533,4		
Vencimientos de CDV BCRP del 5 al 7 de abril de 2023	0,0			0,0			2 832,4		
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 5 al 7 de abril 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	0,0			0,0					
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo									
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 5 al 7 de abril de 2023									
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		
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 10 de Abril del 2023	300,0			300,0			300,0		
Vencimiento de Coloc-TP del 5 al 7 de abril de 2023	0,0			0,0			300,0		
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 5 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					
Próximo vencimiento de CDR BCRP									
Vencimiento de CDR BCRP del 5 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 5 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		
Próximo vencimiento de Repo Regular el 10 de Abril del 2023	100,0			100,0			100,0		
Vencimiento de REPO del 5 al 7 de abril de 2023	0,0			0,0			100,0		
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento									
Tasas de interés: Mínima									
Máxima									
Promedio									
Saldo									
Próximo vencimiento de Reso									
Vencimiento de REPO del 5 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 5 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 5 al 7 de abril de 2023									
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200,0	200,1		300,0	200,0	200,0	300,0	200,0	
Propuestas recibidas	720,0	630,0		960,0	495,0	405,0	960,0	355,0	
Plazo de vencimiento	366 d	366 d		366 d	366 d	366 d	366 d	366 d	
Tasas de interés: Mínima	5,55	5,54		5,49	5,49	5,50	5,47	5,45	
Máxima	5,59	5,60		5,55	5,51	5,58	5,48	5,46	
Promedio	5,57	5,58		5,53	5,50	5,55	5,47	5,46	
Saldo	37 559,3			37 389,3			37 049,3		
Próximo vencimiento de SC-Venta el 5 de Abril del 2023	870,0			840,0			570,0		
Vencimiento de SC - Venta del 5 al 7 de abril de 2023	1 710,0			840,0			3 145,0		
xxi. Subasta de Reso de Valores para proveer dólares (RED)									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento									
Tasas de interés: Mínima									
Máxima									
Promedio									
Saldo	0,0			0,0					
Próximo vencimiento de RED									
Vencimiento de RED del 5 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	850,0			820,0			820,0		
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 6 de Abril del 2023	30,0			35,0			35,0		
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 5 al 7 de abril de 2023	30,0			0,0			30,0		
b. Liquid. Reces 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		
i. Compras (millones de US$)	0,0			0,0			0,0		
Tipo de cambio promedio	0,0			0,0			0,0		
ii. Ventas (millones de US$)	0,0			0,0			0,0		
Tipo de cambio promedio	0,0			0,0			0,0		
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0,0			0,5			0,0		
i. Compras (millones de US$)	0,0			0,5			0,0		
ii. Ventas (millones de US$)	0,0			0,0			0,0		
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	79,1			0,0			81,2		
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR									
ii. Compras de BTP (Valorizado)	79,1			0,0			81,2		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**12 912,4**			**12 304,8**			**10 983,0**		
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones									
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).									
Tasa de interés (Costo efectivo anual)	0,0226%			0,0226%			0,0226%		
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0			0,0			0,0		
Tasa de interés									
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional									
Tasa de interés									
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0			0,0			178,0		
Tasa de interés	5,25%			5,25%			5,25%		
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**12 912,4**			**12 304,8**			**10 805,0**		
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 081,9			15 074,6			15 881,2		
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	6,0			7,4			7,8		
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 952,4			7 764,3			8 550,9		
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	2,4			3,8			4,2		
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP									
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	793,7			1 005,9			897,7		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7,75 / 7,75 / 7,75			7,75 / 7,75 / 7,75			7,75 / 7,75 / 7,75		
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	39,0			40,0			44,0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5,00 / 5,00 / 5,00			5,00 / 5,00 / 5,00			5,00 / 5,00 / 5,00		
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.31 2023**			**Abr.03 2023**			**Abr.04 2023**		
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	73,8			6,5			-12,5		
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	56,9			101,8			145,7		
a. Mercado spot con el público	68,6			111,1			180,5		
i. Compras	929,0			810,4			723,8		
ii. (-) Ventas	860,4			699,3			543,3		
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	140,9			29,6			-427,6		
i. Pactadas	343,6			182,1			328,4		
ii. (-) Vencidas	202,7			152,5			755,9		
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	99,8			49,5			-304,2		
i. Pactadas	282,6			244,6			529,5		
ii. (-) Vencidas	182,8			195,0			833,7		
d. Operaciones cambiarias interbancarias									
i. Al contado	473,5			531,1			682,4		
ii. A futuro	10,0			40,0			20,0		
e. Operaciones sont asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-17,1			35,7			45,0		
i. Compras	182,1			178,4			795,9		
ii. (-) Ventas	199,2			142,6			750,9		
f. Efecto de Opciones	0,0			-0,1			0,0		
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-38,8			-77,8			-36,9		
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera									
Tasa de interés									
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,7621			3,7674			3,7718		

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera