BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	17 Abr 23	18 Abr 23	19 Abr 23	20 Abr 23	21 Abr 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**7 677.7**	**6 851.8**	**6 172.7**	**4 641.8**	**2 496.6**
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)	700.0 300.0	700.0 300.0	700.0 300.0		
Propuestas recibidas	2130.0 1076.5	2045.0 815.0	1320.0 648.0		
Plazo de vencimiento	183 d 91 d	182 d 90 d	183 d 89 d		
Tasas de interés: Mínima	7.58 7.55	7.58 7.60	7.58 7.60		
Máxima	7.60 7.65	7.59 7.65	7.59 7.65		
Promedio	7.59 7.63	7.59 7.63	7.59 7.63		
Saldo	20 504.2	21 522.3	22 526.0	22 526.0	22 526.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de Mayo del 2023	60.0	60.0	60.0	60.0	60.0
Vencimiento de CD BCRP del 24 al 28 de abril de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					500.0
Propuestas recibidas					1000.0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					8.45
Máxima					8.56
Promedio					8.49
Saldo	10 508.4	10 508.4	10 508.4	10 508.4	10 508.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de Abril del 2023	450.0	450.0	450.0	450.0	400.0
Vencimiento de Reco Valores del 24 al 28 de abril de 2023	450.0	450.0	450.0	450.0	400.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					0.0
Próximo vencimiento de Reco de Cartera General					
Vencimiento de Reco de Cartera General del 24 al 28 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	3.7	3.7	3.7	3.7
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 24 al 28 de abril 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 24 al 28 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
Próximo vencimiento de Reco de Cartera para el Apoyo de Liquidez					0.0
Vencimientos de Reco de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 24 al 28 de abril de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	8 852.6	8 852.6	8 852.6	8 852.6	8 552.6
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 21 de Abril del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	1 200.0
Vencimientos de CDV BCRP del 24 al 28 de abril de 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	1 200.0
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 24 al 28 de abril de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 500.0 1 700.0	2 500.0 1 500.0	2 499.9 1 100.0	2 500.0 645.8	1 499.9 826.4
Propuestas recibidas	2 888.0 3 125.3	3 248.3 2 061.5	3 253.4 1 396.4	2 672.4 645.8	1 499.9 826.4
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	7.35 7.25	7.50 7.38	7.60 7.64	7.65 7.64	7.68 7.64
Máxima	7.69 7.65	7.75 7.74	7.75 7.73	7.75 7.73	7.75 7.75
Promedio	7.66 7.51	7.68 7.57	7.73 7.65	7.73 7.71	7.73 7.72
Saldo	3 200.0	4 000.0	3 599.9	3 145.8	2 317.3
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 21 de Abril del 2023	3 200.0	4 000.0	3 599.9	3 145.8	2 317.3
Vencimientos de Depósitos a Plazo del 24 al 28 de abril de 2023	3 200.0	4 000.0	3 599.9	3 145.8	2 317.3
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					300.0
Propuestas recibidas					605.5
Plazo de vencimiento					182 d
Tasas de interés: Mínima					8.65
Máxima					8.65
Promedio					8.24
Saldo	6 729.7	6 729.7	6 729.7	6 729.7	6 729.7
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 21 de Abril del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 24 al 28 de abril de 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	600.0
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 24 al 28 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	60.0	60.0	60.0	60.0	60.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	60.0	60.0	60.0	60.0	60.0
Vencimiento de CDR BCRP del 24 al 28 de abril 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)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 24 al 28 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	482.0	482.0	482.0	482.0	482.0
Próximo vencimiento de Reco Regular	27.0	27.0	27.0	27.0	27.0
Vencimiento de REPO del 24 al 28 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 24 al 28 de abril de 2023					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Excepción)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Excepcion					
Vencimiento de REPO Excepción del 24 al 28 de abril de 2023					
xix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Facilitador)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 24 al 28 de abril de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0 175.0 180.0 10.0	200.0	300.0 265.0	160.0 150.0	300.0 40.0 300.0
Propuestas recibidas	510.0 385.0 538.0 60.0	510.0	615.0 575.0	300.0 220.0	1135.0 750.0 390.0
Plazo de vencimiento	366 d 275 d 183 d 183 d	183 d	183 d 366 d	183 d 365 d	182 d 90 d 182 d
Tasas de interés: Mínima	5.94 5.94 6.10 6.15	6.12	6.12 5.97	6.15 5.99	5.94 5.49 6.10
Máxima	6.00 6.08 6.15 6.15	6.14	6.15 5.99	6.15 6.10	5.94 5.58 6.13
Promedio	5.96 6.03 6.12 6.15	6.14	6.14 5.98	6.15 6.01	5.94 5.53 6.12
Saldo	36 021.3	35 861.3	35 683.3	35 293.3	34 960.3
Próximo vencimiento de SC-Venta el 21 de Abril del 2023	360.0	743.0	700.0	973.0	800.1
Vencimiento de SC - Venta del 24 al 28 de abril de 2023	2 776.0	2 416.0	1 673.0	973.0	2 144.1
xxi. Subasta de Reco de Valores para sinvser dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					0.0
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 24 al 28 de abril de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	705.0	675.0	675.0	675.0	675.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 22 de Abril del 2023	30.0	50.0	50.0	50.0	50.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 24 al 28 de abril de 2023	30.0	0.0	0.0	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	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$)	0.0	11.0	1.0	0.0	0.6
i. Compras (millones de US$)	0.0	5.5	1.0	0.0	0.6
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	5.5	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	69.2	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	69.2	0.0	69.2	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 304.7**	**2 794.8**	**2 496.1**	**2 472.8**	**1 768.6**
4. Operaciones monetarias del BCR cons el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0225%	0.0226%	0.0226%	0.0226%	0.0217%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 047.0	516.5	619.5	804.6	528.8
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3 257.7**	**2 278.3**	**1 876.6**	**1 668.2**	**1 239.8**
e. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	15 285.7	14 955.5	14 621.3	14 320.3	14 060.1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.5	7.4	7.3	7.1	6.9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 970.8	7 648.5	7 314.3	7 015.3	6 755.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.9	3.8	3.6	3.5	3.3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	719.2	1 011.6	1 213.8	1 513.1	1 200.7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.50 / 7.75 / 7.50	7.50 / 7.75 / 7.50	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.85 / 7.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	52.0	66.0	114.0	104.0	94.3
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 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$)	**Abr.14 2023**	**Abr.17 2023**	**Abr.18 2023**	**Abr.19 2023**	**Abr.20. 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	13.9	70.5	40.8	-34.0	-22.8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-122.9	36.9	-25.3	185.7	-13.3
a. Mercado spot con el público	-122.1	42.8	-9.5	205.9	25.2
i. Compras	322.3	489.0	296.7	424.5	511.2
ii. (-) Ventas	444.4	446.4	306.2	218.6	486.0
b. Compras forward o swap al público (con v sin entrega)	288.3	34.1	82.4	-19.7	-53.1
i. Pactadas	384.2	121.9	251.3	307.6	257.7
ii. (-) Vencidas	95.9	87.7	168.9	327.3	310.8
c. Ventas forward o swap al público (con v sin entrega)	95,0	94,2	-26,6	160,1	-143,5
i. Pactadas	246.7	311.7	352.7	513.2	439.2
ii. (-) Vencidas	151.7	217.5	379.3	353.1	582.7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	419.8	186.9	379.9	319.6	576.8
ii. A futuro	5.0	25.0	10.0	40.0	0.0
e. Operaciones asoc asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entrega	60.7	122.7	208.1	19.4	265.2
i. Compras	149.5	208.4	375.2	343.2	568.5
ii. (-) Ventas	88.9	85.6	167.0	323.9	303.3
f. Efecto de Opciones	-3,0	-1,2	0,5	0,1	-2,5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-59,1	-44,7	-56,9	-53,8	-129,2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7817	3.7832	3.7770	3.7777	3.7632
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera