BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	06 Mar 23	07 Mar 23	08 Mar 23	09 Mar 23	10 Mar 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**11 445,7**	**11 950,0**	**16 364,2**	**16 071,8**	**8 348,2**
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)		200.0 68.9	300.0 150.0	200.0 300.0 150.0	200.0 300.0
Propuestas recibidas		666.0 68.9	1 199.0 150.0	808.0 731.5 150.0	774.4 602.0
Plazo de vencimiento		34 d 34 d	33 d 33 d	183 d 32 d 32 d	182 d 31 d
Tasas de interés: Mínima		7.60 7.70	7.50 7.65	7.70 7.60 7.70	7.70 7.65
Máxima		7.72 7.70	7.70 7.65	7.74 7.72 7.70	7.72 7.70
Promedio		7.70 7.70	7.65 7.65	7.73 7.70 7.70	7.72 7.69
Saldo	11 968.3	12 237.2	12 687.2	13 337.2	14 087.2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Marzo del 2023	1 750.0	1 750.0	1 750.0	1 750.0	1 750.0
Vencimiento de CD BCRP del 13 al 17 de marzo de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	4 035.3
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					300.0
Propuestas recibidas					600.0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					8.35
Máxima					8.48
Promedio					8.44
Saldo	10 608.4	10 608.4	9 108.4	9 108.4	9 408.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 15 de Marzo del 2023	1 500.0	1 500.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Repo Valores del 13 al 17 de marzo de 2023	1 500.0	1 500.0	0.0	0.0	600.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Propuestas 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 13 al 17 de marzo 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 Repo de Cartera Alternativo	3.7	3.7	3.7	3.7	3.7
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 13 al 17 de marzo 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 13 al 17 de marzo 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					
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez					
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 13 al 17 de marzo de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)				300.0	300.0
Propuestas recibidas				1200.0	920.0
Plazo de vencimiento				92 d	91 d
Márgen: Mínima				-0.08	-0.09
Máxima				-0.08	-0.08
Promedio				-0.08	-0.08
Saldo	16 323.4	16 323.4	16 323.4	16 623.4	16 923.4
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 17 de Marzo del 2023	1 162.5	1 162.5	1 162.5	1 162.5	1 162.5
Vencimientos de CDV BCRP del 13 al 17 de marzo de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	1 162.5
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 13 al 17 de marzo de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)		1 000.0 500.0 1400.0	500.0 500.0 1000.0	1 000.0 500.0 1100.0	1 000.0 500.0 5652.8
Propuestas recibidas		3 123.5 667.5 3484.4	1 751.5 1 367.0 2145.2	1 947.5 1 099.5 2373.5	2 023.5 585.5 1862.8
Plazo de vencimiento		1 d 7 d 1 d	1 d 7 d 1 d	1 d 7 d 1 d	3 d 7 d 3 d
Tasas de interés: Mínima		7.00 7.48 6.90	7.00 7.50 6.90	7.00 7.50 7.0	7.50 7.64 7.50
Máxima		7.59 7.72 7.55	7.55 7.70 7.50	7.72 7.73 7.71	7.72 7.72 7.75
Promedio		7.51 7.64 7.38	7.41 7.61 7.35	7.62 7.63 7.52	7.69 7.72 7.65
Saldo		2 700.0	2 300.0	3 400.0	4 462.8
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 14 de Marzo del 2023		2 400.0	1 500.0	2 100.0	2 662.8
Vencimientos de Depósitos a Plazo del 13 al 17 de marzo de 2023		2 400.0	1 500.0	2 100.0	4 462.8
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0	233.9			
Propuestas recibidas	981.6	608.9			
Plazo de vencimiento	182 d	184 d			
Tasas de interés: Mínima	8.34	7.98			
Máxima	8.52	8.35			
Promedio	8.40	8.25			
Saldo	6 495.9	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 13 al 17 de marzo 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 13 al 17 de marzo 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					
Próximo vencimiento de CDR BCRP					
Vencimiento de CDR BCRP del 13 al 17 de marzo 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 13 al 17 de marzo de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	782.0	782.0	782.0	782.0	782.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 24 de Marzo del 2023	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de REPO del 13 al 17 de marzo 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 Repo					
Vencimiento de REPO del 13 al 17 de marzo 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 Repo Excepción					
Vencimiento de REPO Excepción del 13 al 17 de marzo 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 13 al 17 de marzo de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0 200.0	300.0			
Propuestas recibidas	390.0 265.0	1025.0			
Plazo de vencimiento	275 d 183 d	275 d			
Tasas de interés: Mínima	5.45 5.45	5.45			
Máxima	5.58 5.60	5.53			
Promedio	5.51 5.52	5.49			
Saldo	38 375.2	38 375.2	38 375.2	38 375.2	38 375.2
Próximo vencimiento de S/.Venta el 13 de Marzo del 2023	300.0	40.0	40.0	40.0	40.0
Vencimiento de S/. - Venta del 13 al 17 de marzo de 2023	300.0	0.0	0.0	0.0	40.0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 13 al 17 de marzo de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 200.0	1 200.0	1 200.0	1 200.0	1 150.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 12 de Marzo del 2023	50.0	50.0	50.0	50.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 13 al 17 de marzo de 2023	50.0	50.0	50.0	50.0	80.0
b. Liquid. Repos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
ii. Ventas (millones de US$)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	0.2	1.6	0.2	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.2	1.6	0.2	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**11 736,7**	**10 169,1**	**8 843,9**	**7 502,3**	**5 446,7**
4. Operaciones monetarias del BCR con el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0225%	0.0225%	0.0225%	0.0225%	0.0225%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por reculación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 408.0	943.7	543.3	935.4	905.4
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**10 328,7**	**9 225,4**	**8 300,6**	**6 566,9**	**4 541,3**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	18 713.6	18 456.8	18 055.2	17 666.7	17 096.9
b. Exceso de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TRAM) (*)	9.5 %	9.2 %	9.0 %	8.8 %	8.5 %
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	11 584.8	11 336.8	10 936.2	10 591.7	9 981.9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TRAM) (*)	5.8	5.6	5.4	5.3	5.0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 342.7	1 316.8	1 701.2	1 052.9	699.1
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.00 / 7.75 / 7.74	7.50 / 7.75 / 7.75	7.50 / 7.75 / 0.00	7.50 / 7.75 / 7.73	7.50 / 7.75 / 7.73
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	40.0	40.0	61.0	46.0	73.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	4.75 / 4.75 / 4.75	4.75 / 5.00 / 4.78	4.75 / 4.75 / 4.75	4.75 / 4.75 / 4.75	4.75 / 4.80 / 4.75
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$)	**Mar.03 2023**	**Mar.06 2023**	**Mar.07 2023**	**Mar.08 2023**	**Mar.09 2023**
Flujo de la posición diaria: = a + b.i - c.i + e + f + g	-30.7	52.5	-50.2	-8.0	28.5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-0.2	-20.4	-53.9	-32.5	84.2
a. Mercado spot con el público	21.0	-17.0	-54.0	-29.8	75.8
i. Compras	524.1	502.1	399.4	441.1	918.2
ii. (-) Ventas	503.1	519.0	453.4	470.9	842.3
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	107.9	125.8	203.0	-118.9	-79.8
i. Pactadas	223.6	205.6	373.1	172.3	239.3
ii. (-) Vencidas	115.7	79.8	170.1	291.2	319.1
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	137.8	26.8	200.6	-143.5	-23.9
i. Pactadas	404.7	175.1	485.5	380.1	463.6
ii. (-) Vencidas	266.9	148.4	284.9	523.5	487.5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	344.0	310.0	532.4	427.5	603.4
ii. A futuro	13.0	98.0	55.0	52.0	0.0
e. Operaciones soc asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	134.7	77.2	116.2	233.4	183.1
i. Compras	247.6	146.5	284.5	522.5	478.4
ii. (-) Ventas	112.9	69.2	168.3	289.1	295.3
f. Efecto de Opciones	-0.5	-1.2	0.2	-0.1	0.4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-4.8	-57.1	-0.1	-3.7	-6.5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7854	3.7854	3.7870	3.7857	3.7899

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera