BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	02 May 23	03 May 23	04 May 23	05 May 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**-162,7**	**2 164,9**	**2 799,3**	**2 572,8**
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	22 526,0	22 466,0	22 466,0	22 466,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Mayo del 2023	60,0	750,0	750,0	750,0
Vencimiento de CD BCRP del 8 al 12 de mayo de 2023	60,0	0,0	0,0	750,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	5000,1 1000,0 2920,0	5000,0 500,0 500,0 3000,0	4000,0 500,0 500,0 2800,0	4000,0 500,0 500,0 500,0 2815,0
Propuestas recibidas	8150,0 1020,0 1697,0	5265,0 1250,0 1200,0 3000,0	7520,0 1300,0 1100,0 3435,0	235,0 1650,0 1100,0 800,0 2815,0
Plazo de vencimiento	1 d 31 d 7 d 1 d	1 d 34 d 7 d 1 d	1 d 35 d 7 d 1 d	3 d 94 d 35 d 7 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	7,98 8,08 7,85 7,75	7,75 8,17 8,02 7,75	7,81 8,15 7,85 7,76	7,81 8,38 8,28 7,85 7,77
Máxima	8,06 8,26 8,07 8,11	8,04 8,30 8,07 7,85	8,04 8,26 7,95 7,90	7,93 8,52 8,28 7,90 7,85
Promedio	8,02 8,22 7,97 7,82	7,86 8,24 8,03 7,78	7,86 8,22 7,91 7,83	7,87 8,43 8,28 7,87 7,82
Saldo	20 078,5	20 658,4	19 958,4	20 973,4
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 8 de Mayo del 2023	8 420,1	8 500,0	7 300,0	6 815,0
Vencimiento de Repo Valores del 8 al 12 de mayo de 2023	9 420,1	9 000,0	7 300,0	9 615,0
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 Reso de Cartera General del 8 al 12 de mayo 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
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativo	3,7	3,7	3,7	3,7
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 8 al 12 de mayo de 2023	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
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
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 8 al 12 de mayo 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 8 al 12 de mayo de 2023				
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Mínimo: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	7 352,6	6 902,6	6 902,6	6 902,6
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 12 de Mayo del 2023	450,0	750,0	750,0	750,0
Vencimientos de CDV BCRP del 8 al 12 de mayo de 2023	450,0	0,0	0,0	750,0
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 8 al 12 de mayo 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				
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo				
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 8 al 12 de mayo de 2023				
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300,0		300,0	
Propuestas recibidas	773,7		478,4	
Plazo de vencimiento	184 d		183 d	
Tasas de interés: Mínima	8,42		8,46	
Máxima	8,47		8,59	
Promedio	8,45		8,49	
Saldo	6 729,7	6 729,7	6 729,7	6 729,7
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 8 de Mayo del 2023	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 8 al 12 de mayo de 2023	300,0	300,0	0,0	795,5
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 8 al 12 de mayo 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
Próximo vencimiento de CDR BCRP	60,0	60,0	60,0	60,0
Vencimiento de CDR BCRP del 8 al 12 de mayo de 2023	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 8 al 12 de mayo de 2023				
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)			300,0	
Propuestas recibidas			780,0	
Plazo de vencimiento			35 d	
Tasas de interés: Mínima			8,05	
Máxima			8,30	
Promedio			8,11	
Saldo	482,0	482,0	782,0	782,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 17 de Mayo del 2023	27,0	27,0	27,0	27,0
Vencimiento de REPO del 8 al 12 de mayo de 2023	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 Reso				
Vencimiento de REPO del 8 al 12 de mayo 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 Expansion				
Vencimiento de REPO Expansión del 8 al 12 de mayo 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 Sustitucion				
Vencimiento de REPO Sustitución del 8 al 12 de mayo de 2023				
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200,0 200,0	200,0	200,0	300,0 200,0
Propuestas recibidas	620,0 453,5	605,0	590,0	1400,0 825,0
Plazo de vencimiento	366 d 184 d	366 d	365 d	367 d 367 d
Tasas de interés: Mínima	5,88 5,94	5,73	5,50	5,50 5,54
Máxima	5,92 5,94	5,74	5,66	5,55 5,60
Promedio	5,91 5,91	5,73	5,59	5,52 5,56
Saldo	34 216,2	34 216,2	34 416,2	34 316,2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 8 de Mayo del 2023	200,0	600,0	600,0	125,0
Vencimiento de SC - Venta del 8 al 12 de mayo de 2023	800,0	600,0	600,0	855,0
xxi. Subasta de Reso de Valores cara anverar dólares (REDI)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de REDI				
Vencimiento de REDI del 8 al 12 de mayo de 2023				
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	595,0	595,0	595,0	545,0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 12 de Mayo del 2023	50,0	50,0	50,0	20,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 8 al 12 de mayo de 2023	50,0	50,0	50,0	20,0
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
i. Compras (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0	0,0	0,0	0,0
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0,6	103,9	0,0	2,2
i. Compras (millones de US$)	0,6	103,9	0,0	2,2
ii. Ventas (millones de US$)				
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP		55,3	0,0	47,8
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP (Valorizado)		55,3	0,0	47,8
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**9 557,3**	**11 164,9**	**11 152,3**	**10 887,5**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Tasa de interés efectiva diaria	0.0230%	0.0230%	0.0229%	0.0229%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés				
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	0,0	0,0	30,0
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**9 557,3**	**11 164,9**	**11 152,3**	**10 887,5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 246,5	14 116,8	15 855,5	16 252,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	6,1	6,9	7,7	8,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 938,2	6 617,4	8 156,1	8 752,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	2,4	3,2	4,0	4,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	735,1	806,1	840,8	800,4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)		15,0	5,0	5,0
Tasas de interés: Mínima / Máximo/ Promedio	-/ -/ -	5,00 / 5,00 / 5,00	5,25 / 5,25 / 5,25	5,25 / 5,25 / 5,25
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.28 2023**	**May.02 2023**	**May.03 2023**	**May.04 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-23,3	-22,6	-12,6	15,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-130,2	40,9	89,3	245,1
a. Mercado spot con el público	-73,8	64,0	140,2	249,7
i. Compras	688,6	505,6	697,2	687,6
ii. (-) Ventas	762,4	441,6	557,0	437,9
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	234,8	115,1	127,4	-177,9
i. Pactadas	468,5	420,9	329,6	244,4
ii. (-) Vencidas	233,7	305,8	202,2	422,3
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	130,0	159,2	231,5	103,2
i. Pactadas	551,7	456,2	478,3	669,3
ii. (-) Vencidas	421,7	297,0	246,9	566,0
d. Coberturas cambiarias interbancarias				
i. Al contado	509,1	268,6	563,4	804,4
ii. A futuro	43,0	99,7	58,0	56,0
e. Operaciones sont asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	147,2	-22,8	7,5	138,1
i. Compras	379,1	278,1	205,8	560,1
ii. (-) Ventas	231,9	300,9	198,2	421,9
f. Efecto de Opciones	2,1	0,5	-0,7	-2,3
g. Coberturas netas con otras instituciones financieras	-15,6	-28,8	-10,8	54,8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,7111	3,7106	3,7050	3,7190
(*) Datos preliminares				

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera