BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	20 Feb 23	21 Feb 23	22 Feb 23	23 Feb 23	24 Feb 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 197,2**	**8 564,7**	**8 325,7**	**4 585,5**	**5 983,3**
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)	99,9 200,0	100,0 50,0		100,0 50,0	
Propuestas recibidas	471,6 449,0	370,0 50,0		270,0 50,0	
Plazo de vencimiento	182 d 31 d	181 d 181 d		181 d 181 d	
Tasas de interés: Mínima	7,51 7,50	7,72 7,73		7,75 7,73	
Máxima	7,73 7,70	7,74 7,73		7,74 7,73	
Promedio	7,66 7,68	7,73 7,73		7,73 7,73	
Saldo	15 131,9	13 281,9	13 281,9	13 281,9	13 431,9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de Febrero del 2023	905,8	905,8	905,8	905,8	905,8
Vencimiento de CD BCRP del 27 de febrero al 3 de marzo de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	1 613,6
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				300,0	450,0
Propuestas recibidas				900,0	1550,0
Plazo de vencimiento				32 d	91 d
Tasas de interés: Mínima				8,33	8,35
Máxima				8,33	8,35
Promedio				8,33	8,44
Saldo	8 448,4	8 448,4	8 448,4	8 748,4	9 248,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 27 de Febrero del 2023	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Repo Valores del 27 de febrero al 3 de marzo de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	640,0
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 27 de febrero al 3 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	6 333,2	6 333,2	6 333,2	6 333,2	6 333,2
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Marzo del 2023	1,0	1,0	1,0	1,0	1,0
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 27 de febrero al 3 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 27 de febrero al 3 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 27 de febrero al 3 de marzo de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	500,0	300,0 116,5	300,0	300,0 150,0	
Propuestas recibidas	1045,0	660,0 116,5	370,0	720,0 150,0	
Plazo de vencimiento	92 d	91 d 91 d	90 d	91 d 91 d	
Margen: Mínima	-0,07	-0,06 -0,06	-0,06	-0,07 -0,06	
Máxima	-0,05	-0,06 -0,06	0,00	-0,03 -0,06	
Promedio	-0,06	-0,06 -0,06	-0,03	-0,06 -0,06	
Saldo	17 397,6	17 804,1	18 104,1	18 104,1	17 954,1
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 28 de Febrero del 2023	1 050,0	1 050,0	1 050,0	1 050,0	1 034,7
Vencimientos de CDV BCRP del 27 de febrero al 3 de marzo de 2023	1 050,0	1 050,0	1 050,0	1 050,0	1 734,7
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 27 de febrero al 3 de marzo de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 000,0 500,1 2100,1	2 500,0 500,0 1900,0	1 999,9 500,1 5600,0	1 500,0 1 499,9	3 817,9
Propuestas recibidas	3 400,0 1 233,5 2605,2	2 829,5 548,0 1992,5	2 518,0 1 022,0 2284,0	2 659,0 1 621,0	3 817,9
Plazo de vencimiento	7 d 7 d 1 d	7 d 7 d 1 d	1 d 7 d 1 d	1 d 7 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	7,65 7,68 6,10	7,15 7,40 7,00	7,70 7,71 7,60	7,65 7,69	6,89
Máxima	7,74 7,74 7,75	7,75 7,74 7,75	7,75 7,75 7,71	7,75 7,75	6,89
Promedio	7,72 7,73 7,66	7,73 7,73 7,62	7,74 7,72 7,59	7,71 7,73	7,61
Saldo	7 100,3	6 999,2	6 100,2	2 000,2	2 318,1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 27 de Febrero del 2023	5 100,1	4 900,0	4 099,9	3 500,0	4 318,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 27 de febrero al 3 de marzo de 2023	6 600,2	5 900,1	4 600,0	3 500,0	5 318,1
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300,0		300,0		
Propuestas recibidas	691,8		642,0		
Plazo de vencimiento	182 d		181 d		
Tasas de interés: Mínima	8,40		8,45		
Máxima	8,65		8,64		
Promedio	8,53		8,52		
Saldo	6 795,8	6 795,8	6 795,8	6 795,8	6 795,8
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Febrero del 2023	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 27 de febrero al 3 de marzo de 2023	300,0	300,0	0,0	0,0	900,0
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 27 de febrero al 3 de marzo de 2023					
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (VAC BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDR BCRP					
Vencimiento de CDR BCRP del 27 de febrero al 3 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 27 de febrero al 3 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	750,0	750,0	750,0	750,0	750,0
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 27 de febrero al 3 de marzo de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de recompra					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco					
Vencimiento de REPO del 27 de febrero al 3 de marzo de 2023					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Ecoseguro)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 27 de febrero al 3 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 27 de febrero al 3 de marzo de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			200,0		250,0
Propuestas recibidas			400,0		737,0
Plazo de vencimiento			273 d		273 d
Tasas de interés: Mínima			5,56		5,47
Máxima			5,59		5,55
Promedio			5,53		5,50
Saldo	38 919,2	38 919,2	38 619,2	38 319,2	38 319,2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 28 de Febrero del 2023	500,0	500,0	300,0	200,0	200,0
Vencimiento de SC - Venta del 27 de febrero al 3 de marzo de 2023	800,0	800,0	300,0	0,0	464,0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (REVA)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 27 de febrero al 3 de marzo de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 360,0	1 360,0	1 360,0	1 360,0	1 360,0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 27 de Febrero del 2023	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 27 de febrero al 3 de marzo de 2023	30,0	0,0	0,0	0,0	130,0
b. Liquid. Reros Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-B					
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$)	1,4	1,2	2,7	0,8	2,5
i. Compras (millones de US$)	1,4	1,2	2,7	0,8	2,5
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 938,1**	**2 156,2**	**1 869,6**	**2 205,2**	**2 664,5**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps):					
Tasa de interés (tasa de corte)	0,0221%	0,0222%	0,0223%	0,0224%	0,0224%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	925,9	648,2	536,3	1 174,6	702,3
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2 662,2**	**1 910,9**	**1 333,3**	**1 030,6**	**1 962,2**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13 884,2	13 671,2	11 198,0	13 212,7	12 997,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,8	6,7	5,5	6,5	6,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 570,4	6 357,5	6 114,8	5 869,4	5 683,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,2	3,1	3,0	2,9	2,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	516,7	1 971,7	1 172,0	1 148,4	572,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7,75 / 7,75 / 0,00	7,75 / 7,75 / 7,75	7,75 / 7,75 / 7,75	7,75 / 7,90 / 0,00	7,75 / 7,90 / 7,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	67,0	26,0	6,0	6,0	6,0
Tasas de interés: Mínima / Máximo/ Promedio	4,75 / 4,80 / 4,75	4,75 / 4,75 / 4,75	4,75 / 4,75 / 4,75	4,75 / 4,75 / 4,75	4,75 / 4,75 / 4,75
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$)	**Feb.17 2023**	**Feb.20 2023**	**Feb.21 2023**	**Feb.22 2023**	**Feb.23 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e.i + g	-26,4	-7,5	-5,5	-35,7	50,1
Flujo de la posición contable = a + b.i - c.i + e.i + g	-50,4	64,2	-171,2	-0,6	-55,0
a. Mercado spot con el público	28,9	56,4	178,4	24,4	49,4
i. Compras	518,2	231,8	524,2	410,0	607,7
ii. (-) Ventas	577,0	163,4	702,2	416,3	658,2
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	171,5	33,7	1,2	27,4	213,2
i. Pactadas	238,9	56,4	252,0	174,3	448,7
ii. (-) Vencidas	67,4	21,6	250,8	146,9	681,9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	152,6	100,3	-169,4	33,0	-264,0
i. Pactadas	306,5	114,1	206,8	248,5	430,8
ii. (-) Vencidas	153,9	7,8	371,2	236,5	824,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	211,6	164,3	427,7	347,6	380,8
ii. A futuro	12,0	0,0	0,0	20,0	57,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	87,4	6,4	131,3	330,1	172,7
i. Compras	149,9	4,1	376,1	297,3	823,7
ii. (-) Ventas	52,3	3,8	238,8	137,2	651,1
f. Efecto de Opciones	9,1	0,9	-0,8	1,3	2,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	2,5	1,7	-4,1	-80,6	-56,2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,8410	3,8470	3,8323	3,8238	3,7974
(*) Tasas preliminares					

Elaborado: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera