BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	27 Feb 23	28 Feb 23	01 Mar 23	02 Mar 23	03 Mar 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**5 965,3**	**7 608,9**	**7 870,1**	**10 922,6**	**9 873,6**
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)		100,0			
Propuestas recibidas		335,0			
Plazo de vencimiento		185 d			
Tasas de interés: Mínima		7,72			
Máxima		7,74			
Promedio		7,73			
Saldo	12 526,3	12 676,3	12 676,3	11 968,3	11 968,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Marzo del 2023	708,0	708,0	708,0	1 750,0	1 750,0
Vencimiento de CD BCRP del 6 al 10 de marzo de 2023	708,0	708,0	708,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			3000,0 1500,0 1100,0	1000,0 700,0	500,0 700,0
Propuestas recibidas			5580,0 3050,0 2500,0	2300,0 1490,0	1350,0 1650,0
Plazo de vencimiento			1 d 7 d 1 d	1 d 1 d	94 d 3 d
Tasas de interés: Mínima			7,80 7,92 7,83	7,83 7,87	8,30 7,80
Máxima			7,92 7,92 7,87	7,88 7,88	8,46 7,86
Promedio			7,83 7,92 7,84	7,86 7,87	8,39 7,84
Saldo	8 948,4	8 908,4	14 508,4	12 108,4	11 308,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 6 de Marzo del 2023	40,0	300,0	4 100,0	2 000,0	700,0
Vencimiento de Repo Valores del 6 al 10 de marzo de 2023	340,0	300,0	4 400,0	2 000,0	2 200,0
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 Repo de Cartera General					
Vencimiento de Repo de Cartera General del 6 al 10 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
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 6 al 10 de marzo de 2023	0,0	0,0	0,0		1,0
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 6 al 10 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				0,0	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez					
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 6 al 10 de marzo de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)		500,0			
Propuestas recibidas		905,0			
Plazo de vencimiento		94 d			
Márgen: Mínima		-0,08			
Máxima		-0,07			
Promedio		-0,08			
Saldo	17 504,1	17 023,4	17 023,4	16 323,4	16 323,4
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 17 de Marzo del 2023	1 034,7	700,0	700,0	1 162,5	1 162,5
Vencimientos de CDV BCRP del 6 al 10 de marzo de 2023	1 734,7	700,0	700,0	0,0	0,0
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 6 al 10 de marzo de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 952,2	5 506,9			
Propuestas recibidas	3 952,2	5 506,9			
Plazo de vencimiento	1 d	1 d			
Tasas de interés: Mínima	6,99	7,00			
Máxima	7,75	7,75			
Promedio	7,62	7,67			
Saldo	4 952,3	6 007,0		0,0	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	4 452,2	6 007,0			
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 6 al 10 de marzo de 2023	4 952,3	6 007,0			
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300,0				300,0
Propuestas recibidas	727,8				925,6
Plazo de vencimiento	182 d				182 d
Tasas de interés: Mínima	8,66				8,41
Máxima	8,76				8,59
Promedio	8,71				8,49
Saldo	6 795,8	6 795,8	6 795,8	6 495,8	6 495,8
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 6 de Marzo del 2023	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 6 al 10 de marzo de 2023	600,0	600,0	600,0	300,0	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 6 al 10 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				0,0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP					
Vencimiento de CDR BCRP del 6 al 10 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 6 al 10 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 6 al 10 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 6 al 10 de marzo 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 6 al 10 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 Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 6 al 10 de marzo de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		200,0		300,0	
Propuestas recibidas		750,0		890,0	
Plazo de vencimiento		273 d		187 d	
Tasas de interés: Mínima		5,48		5,48	
Máxima		5,53		5,52	
Promedio		5,51		5,50	
Saldo	38 519,2	38 519,2	38 519,2	38 555,2	38 555,2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 6 de Marzo del 2023	200,0	264,0	264,0	580,0	580,0
Vencimiento de SC - Venta del 6 al 10 de marzo de 2023	464,0	264,0	264,0	0,0	880,0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo				0,0	
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 6 al 10 de marzo de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 310,0	1 280,0	1 280,0	1 280,0	1 230,0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 5 de Marzo del 2023	30,0	50,0	50,0	50,0	30,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 6 al 10 de marzo de 2023	80,0	50,0	50,0	50,0	50,0
b. Liquid. Repos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-E					
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$)	1,1	0,0	0,2	0,4	2,6
i. Compras (millones de US$)	1,1	0,0	0,2	0,4	2,6
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3 279,8**	**2 632,5**	**13 470,1**	**12 622,6**	**11 368,9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0223%	0,0224%	0,0226%	0,0225%	0,0225%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 740,2	1 645,6	0,0	93,4	491,9
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 539,6**	**986,9**	**13 470,1**	**12 529,2**	**10 877,0**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 529,7	12 404,7	12 244,1	20 599,1	19 971,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,2	6,1	6,0	10,2	9,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 215,9	5 091,0	4 930,4	13 470,1	12 842,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,6	2,5	2,4	6,7	6,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	933,2	843,3	1 070,9	1 408,0	1 437,7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7,75 / 7,75 / 7,75	7,75 / 7,75 / 7,75	7,50 / 7,75 / 7,75	7,50 / 7,75 / 7,75	7,75 / 7,75 / 7,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	6,0	60,0	50,0	45,0	21,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	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 / 4,75 / 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$)	**Feb.24 2023**	**Feb.27 2023**	**Feb.28 2023**	**Mar.01 2023**	**Mar.02 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-24,5	2,6	53,3	43,0	39,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	101,8	-66,8	44,5	-128,0	-167,9
a. Mercado spot con el público	136,6	-80,1	44,2	-115,5	-153,2
i. Compras	451,5	754,2	950,3	651,6	519,4
ii. (-) Ventas	314,9	834,3	906,2	767,1	672,6
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-204,4	140,9	292,1	267,3	65,4
i. Pactadas	369,9	385,3	435,9	408,2	328,4
ii. (-) Vencidas	574,3	244,4	143,7	140,9	263,0
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-26,6	72,0	285,5	97,9	-131,2
i. Pactadas	650,2	373,5	470,7	315,2	339,5
ii. (-) Vencidas	676,8	301,5	185,2	217,3	470,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	304,3	226,1	619,9	693,6	488,2
ii. A futuro	40,0	50,0	37,0	27,0	70,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	83,1	74,9	61,4	78,6	204,9
i. Compras	653,0	299,7	184,4	189,9	466,8
ii. (-) Ventas	570,0	224,8	123,0	111,3	261,9
f. Efecto de Opciones	-0,9	0,5	1,6	1,6	0,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	37,0	-4,5	-19,1	-14,7	-1,5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,8232	3,8118	3,8057	3,7731	3,7829
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera