BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	13 Mar 23	14 Mar 23	15 Mar 23	16 Mar 23	17 Mar 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 855,2**	**9 305,3**	**8 640,4**	**8 897,8**	**8 628,7**
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)	500.0 300.0	500.0	500.0	600.0	700.0
Propuestas recibidas	1798.0 510.0	1 591.6	1 466.0	1 380.0	1499.3
Plazo de vencimiento	184 d 31 d	183 d	184 d	183 d	186 d
Tasas de interés: Mínima	7.68 7.65	7.65	7.65	7.68	7.63
Máxima	7.71 7.71	7.70	7.69	7.68	7.68
Promedio	7.70 7.68	7.69	7.68	7.68	7.67
Saldo	13 387.2	12 657.5	13 446.7	13 682.5	14 814.5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 22 de Marzo del 2023	1 660.4	624.9	624.9	1 200.0	1 200.0
Vencimiento de CD BCRP del 20 al 24 de marzo de 2023	2 285.3	624.9	624.9	0.0	1 400.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					500.0
Propuestas recibidas					1500.0
Plazo de vencimiento					94 d
Tasas de interés: Mínima					8.51
Máxima					8.51
Promedio					8.51
Saldo	9 498.4	9 498.4	9 498.4	9 498.5	9 498.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores al 24 de Marzo del 2023	500.0	500.0	500.0	500.1	500.0
Vencimiento de Repo Valores del 20 al 24 de marzo de 2023	600.0	600.0	300.0	300.1	300.0
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 20 al 24 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 20 al 24 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 20 al 24 de marzo de 2023					
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acceso de Liquidez					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez					
Vencimientos de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez del 20 al 24 de marzo de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	300.0	300.0			500.0
Propuestas recibidas	800.0	600.0			1070.0
Plazo de vencimiento	93 d	92 d			89 d
Márgen: Mínima	-0.08	-0.08			-0.09
Máxima	-0.08	-0.05			-0.06
Promedio	-0.08	-0.08			-0.07
Saldo	17 223.4	17 523.4	17 523.4	17 523.4	16 860.9
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 21 de Marzo del 2023	1 162.5	1 162.5	1 162.5	1 162.5	700.0
Vencimientos de CDV BCRP del 20 al 24 de marzo de 2023	1 162.5	1 162.5	1 162.5	1 162.5	1 225.5
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 20 al 24 de marzo de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 000.0 1 650.6	1 500.0 1 071.2	1 000.0 2 415.6	1 000.0 2 799.9	1 713.2 2 890.5
Propuestas recibidas	1 822.0 1 950.6	1 726.0 1 071.2	1 597.1 2 415.6	1 141.7 3 205.0	1 713.2 2 890.5
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	7.30 7.30	7.30 7.30	7.50 7.49	7.50 7.50	7.50 7.50
Máxima	7.75 7.75	7.75 7.75	7.74 7.75	7.75 7.75	7.75 7.75
Promedio	7.68 7.67	7.69 7.68	7.70 7.71	7.72 7.72	7.72 7.72
Saldo	4 750.6	4 071.2	4 415.6	4 299.9	4 603.7
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 20 de Marzo del 2023	3 250.6	3 071.2	3 915.6	4 299.9	4 603.7
Vencimientos de Depósitos a Plazo del 20 al 24 de marzo de 2023	4 750.6	4 071.2	4 415.6	4 299.9	4 603.7
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 729.7	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 20 al 24 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 20 al 24 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 20 al 24 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 20 al 24 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 20 al 24 de marzo de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	200.0
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 20 al 24 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 20 al 24 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 20 al 24 de marzo de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300.0	200.0			
Propuestas recibidas	520.0	505.0			
Plazo de vencimiento	275 d	275 d			
Tasas de interés: Mínima	5.30	5.43			
Máxima	5.49	5.47			
Promedio	5.40	5.46			
Saldo	38 635.2	38 835.2	38 835.2	38 835.2	38 835.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 31 de Marzo del 2023	27.0	27.0	27.0	27.0	27.0
Vencimiento de SC - Venta del 20 al 24 de marzo de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	1 127.0
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 20 al 24 de marzo de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 090.0	1 090.0	1 090.0	1 090.0	1 040.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 19 de Marzo del 2023	50.0	50.0	50.0	50.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 20 al 24 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)					
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$)	1.3	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	1.3	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP			84.4		68.5
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR			84.4		68.5
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**8 873,5**	**7 030,9**	**8 790,9**	**8 554,2**	**4 327,7**
4. Operaciones monetarias del BCR con el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0225%	0.0225%	0.0225%	0.0224%	0.0224%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por reculación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	413.0	855.0	283.9	590.0	643.5
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**5 165,5**	**6 175,9**	**5 507,0**	**4 964,2**	**3 684,2**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	15 689.7	15 486.3	15 407.5	15 193.8	14 979.3
b. Exceso en encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TRAM) (*)	7.8	7.7	7.5	7.4	7.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 505.2	8 398.9	8 279.2	8 084.1	7 849.9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TRAM) (*)	4.3	4.2	4.1	4.0	3.9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 041.4	859.6	999.1	959.0	1 055.9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.50 / 7.75 / 7.75	7.70 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.50 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	62.0	123.0	117.0	110.0	95.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ 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 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.10 2023**	**Mar.13 2023**	**Mar.14 2023**	**Mar.15 2023**	**Mar.16 2023**
Flujo de la posición diaria: = a + b.i - c.i + e + f + g	-16.1	4.8	-28.0	-31.6	-20.8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-81.5	-84.0	-104.9	87.8	19.3
a. Mercado spot con el público	-73.7	-86.8	-105.4	91.1	39.6
i. Compras	394.7	623.5	584.3	1240.5	620.0
ii. (-) Ventas	468.4	710.3	689.7	1149.4	580.4
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	129.9	-383.0	198.2	105.8	26.6
i. Pactadas	359.1	291.1	387.3	592.5	67.5
ii. (-) Vencidas	229.3	654.1	189.1	486.7	41.0
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	65.0	-383.7	174.5	224.6	66.8
i. Pactadas	368.5	470.0	380.5	736.0	255.9
ii. (-) Vencidas	303.5	853.7	206.0	511.4	189.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	448.8	391.9	677.7	667.5	1008.2
ii. A futuro	0.0	24.0	82.0	34.0	76.0
e. Operaciones sect.asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	71.1	206.7	18.7	31.1	130.6
i. Compras	288.4	846.5	205.2	504.5	166.2
ii. (-) Ventas	217.3	639.8	186.6	473.4	35.5
f. Efecto de Opciones	0.5	-0.6	0.4	-0.6	0.2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-4.5	64.2	51.6	-9.6	-2.8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7826	3.8031	3.7848	3.8089	3.7985

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera