BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	10 Abr 23	11 Abr 23	12 Abr 23	13 Abr 23	14 Abr 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**6 196,3**	**6 231,0**	**7 887,6**	**8 006,9**	**7 594,0**
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)			500,0 500,0	1000,0	500,0 500,0
Propuestas recibidas			2310,0	3066,8	1497,5 840,5
Plazo de vencimiento			30 d 31 d	32 d	185 d 31 d
Tasas de interés: Mínima			7,50 7,48	7,50	7,55 7,48
Máxima			7,55 7,70	7,54	7,62 7,70
Promedio			7,52 7,62	7,52	7,59 7,62
Saldo	16 011,2	16 011,2	16 761,2	17 243,2	18 870,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de Mayo del 2023	750,0	750,0	750,0	60,0	60,0
Vencimiento de CD BCRP del 17 al 21 de abril de 2023	730,0	730,0	730,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	3000,0 4100,0	2000,0 3000,0	1000,0 1200,0		500,0
Propuestas recibidas	5195,0 5100,0	4190,0 4200,0	1630,0 1700,0		800,0
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d		91 d
Tasas de interés: Mínima	7,85 7,88	7,95 7,89	7,95 7,94		8,45
Máxima	7,97 7,95	7,98 7,97	7,97 7,96		8,69
Promedio	7,89 7,92	7,97 7,93	7,96 7,95		8,57
Saldo	17 608,4	15 508,4	12 708,4	10 508,4	11 008,4
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 17 de Abril del 2023	7 100,0	5 000,0	2 200,0	500,0	500,0
Vencimiento de Repo Valores del 17 al 21 de abril de 2023	7 100,0	5 000,0	2 200,0	0,0	950,0
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 17 al 21 de abril 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 Reso de Cartera Alternativo	3,7	3,7	3,7	3,7	3,7
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 17 al 21 de abril 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 17 al 21 de abril 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 17 al 21 de abril de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	12 929,2	12 929,2	11 395,8	11 395,8	10 096,8
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 17 de Abril del 2023	1 533,4	1 533,4	1 299,0	1 299,0	1 244,2
Vencimientos de CDV BCRP del 17 al 21 de abril de 2023	2 832,4	2 832,4	1 299,0	1 299,0	1 544,2
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 17 al 21 de abril de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)					1 500,0 900,0
Propuestas recibidas					2 840,0 2 554,2
Plazo de vencimiento					3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima					7,00 6,84
Máxima					7,70 7,58
Promedio					7,65 7,41
Saldo					2 400,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de Abril del 2023					2 400,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 17 al 21 de abril de 2023					2 400,0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300,0				
Propuestas recibidas	377,3				
Plazo de vencimiento	183 d				
Tasas de interés: Mínima	8,02				
Máxima	8,32				
Promedio	8,26				
Saldo	6 729,7	6 729,7	6 729,7	6 729,7	6 729,7
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 21 de Abril del 2023	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 17 al 21 de abril de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	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 17 al 21 de abril 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
Próximo vencimiento de CDR BCRP				60,0	60,0
Vencimiento de CDR BCRP del 17 al 21 de abril de 2023				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 17 al 21 de abril de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	482,0	482,0	482,0	482,0	482,0
Próximo vencimiento de Repo Regular	27,0	27,0	27,0	27,0	27,0
Vencimiento de REPO del 17 al 21 de abril 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 Reco					
Vencimiento de REPO del 17 al 21 de abril 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 17 al 21 de abril 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 17 al 21 de abril de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200,0 200,0 105,0	200,0 200,0 200,0	200,0 300,0 200,0	Desierta 200,0 97,0	200,0
Propuestas recibidas	500,0 500,0 120,0	680,0 728,0 390,0	625,0 570,0 490,0	--- 520,0 197,0	430,0
Plazo de vencimiento	366 d 366 d 366 d	366 d 275 d 275 d	366 d 366 d 366 d	368 d 368 d 368 d	367 d
Tasas de interés: Mínima	5,49 5,37 5,53	5,53 5,54 5,64	5,52 5,64 5,70	0,00 5,65 5,83	5,85
Máxima	5,54 5,53 5,60	5,57 5,67 5,75	5,64 5,73 5,83	0,00 5,82 5,90	5,98
Promedio	5,50 5,45 5,59	5,54 5,62 5,72	5,57 5,68 5,76	0,00 5,78 5,88	5,93
Saldo	36 984,3	36 844,3	36 819,3	36 416,3	36 206,3
Próximo vencimiento de SC-Venta el 17 de Abril del 2023	740,0	725,0	700,0	410,0	750,0
Vencimiento de SC - Venta del 17 al 21 de abril de 2023	2 575,0	1 835,0	1 110,0	410,0	3 526,0
xxi. Subasta de Reso de Valores para crowser dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 17 al 21 de abril de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	785,0	755,0	755,0	755,0	755,0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 15 de Abril del 2023	30,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 17 al 21 de abril de 2023	30,0	0,0	0,0	0,0	30,0
b. Liquid. Reoss Carteras 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$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US$)	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$)	1,4	0,0	0,6	0,0	37,9
i. Compras (millones de US$)	1,4	0,0	0,6	0,0	7,3
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	30,6
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	86,4	0,0	79,3	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	86,4	0,0	79,3	0,0	0,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**13 552,3**	**11 231,0**	**9 587,6**	**7 062,0**	**5 259,0**
4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0,0225%	0,0225%	0,0226%	0,0226%	0,0216%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 520,0	1 384,9	1 401,0	1 459,0	887,9
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**12 552,3**	**9 846,1**	**8 186,6**	**5 603,0**	**4 371,1**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	15 846,9	16 984,4	16 816,6	16 591,9	16 145,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,8	8,3	8,3	8,2	7,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 536,6	9 674,1	9 506,3	9 277,1	8 830,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,2	4,7	4,7	4,6	4,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 938,4	1 813,0	2 139,5	1 935,7	1 289,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7,75 / 7,75 / 7,75	7,75 / 7,75 / 7,75	7,50 / 7,75 / 7,74	7,00 / 7,75 / 7,72	7,75 / 7,85 / 7,75
b. Coberiones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	60,0	71,0	55,0	55,0	55,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00
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.05 2023**	**Abr.10 2023**	**Abr.11 2023**	**Abr.12 2023**	**Abr.13 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e.f + g	28,5	17,8	-90,7	2,7	90,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	86,5	-44,3	109,1	50,4	-12,1
a. Mercado spot con el público	87,5	6,5	124,4	40,5	-32,1
i. Compras	558,4	494,4	992,8	451,1	496,1
ii. (-) Ventas	470,9	487,9	868,4	410,6	528,2
b. Compras forward v swap al público (con v sin entrega)	-29,0	25,5	-102,8	-3,1	-285,9
i. Pactadas	191,1	170,8	232,3	202,6	464,7
ii. (-) Vencidas	220,1	145,4	335,2	205,8	750,6
c. Ventas forward v swap al público (con v sin entrega)	-59,0	-51,7	67,9	41,4	498,9
i. Pactadas	287,1	185,5	404,4	334,2	535,2
ii. (-) Vencidas	346,1	237,2	336,5	292,8	1034,1
d. Coberiones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	553,4	288,8	440,7	273,0	518,9
ii. A futuro	15,0	63,0	60,0	66,0	50,0
e. Operaciones sod asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entrega	129,2	37,5	-16,2	98,8	281,6
i. Compras	343,3	181,2	317,7	291,9	1030,3
ii. (-) Ventas	214,0	143,8	333,9	193,1	748,8
f. Efecto de Cociones	-0,3	-1,6	-1,2	1,4	-4,3
g. Coberiones netas con otras instituciones financieras	-93,9	-10,0	-25,7	-6,5	-84,1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,7722	3,7800	3,7864	3,7749	3,7758
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera