BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	28 Nov 22	29 Nov 22	30 Nov 22	01 Dic 22	02 Dic 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**3 861.5**	**3 093.0**	**2 522.5**	**2 321.2**	**2 506.3**
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)		140.0			
Propuestas recibidas		335.0			
Plazo de vencimiento		185 d			
Tasas de interés: Mínima		7.10			
Máxima		7.35			
Promedio		7.21			
Saldo	12 254.4	12 394.4	12 394.4	12 394.4	12 394.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de Diciembre del 2022	450.0	450.0	450.0	450.0	450.0
Vencimiento de CD BCRP del 5 al 9 de diciembre de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			1000.0 40.0	4000.0 1000.0 4000.0	4000.0 300.0 700.0 2500.0
Propuestas recibidas			1150.0 40.0	6275.0 2100.0 5695.0	7485.0 900.0 1400.0 4295.0
Plazo de vencimiento			1 d 90 d	1 d 6 d 1 d	3 d 91 d 10 d 3 d
Tasas de interés: Mínima			7.31 7.94	7.27 7.56 7.28	7.31 7.96 7.32 7.32
Máxima			7.35 7.94	7.50 7.56 7.40	7.40 8.02 7.32 7.41
Promedio			7.31 7.94	7.37 7.56 7.35	7.36 7.99 7.32 7.36
Saldo	9 868.4	9 868.4	10 448.4	10 448.4	17 448.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 5 de Diciembre del 2022	450.0	450.0	1 000.0	6 300.0	7 700.0
Vencimiento de Repo Valores del 5 al 9 de diciembre de 2022	750.0	750.0	1 300.0	8 300.0	8 700.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General					
Vencimiento de Repo de Cartera General del 5 al 9 de diciembre de 2022					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 378.6	6 378.6	6 378.6	6 378.6	6 378.6
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 26 de Diciembre del 2022	9.7	9.7	9.7	9.7	9.7
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 5 al 9 de diciembre de 2022	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 5 al 9 de diciembre de 2022					
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	0.0	0.0	0.0	0.0	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez					
Vencimientos de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez del 5 al 9 de diciembre de 2022					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	1000.0	700.0			
Propuestas recibidas	1580.0	740.0			
Plazo de vencimiento	92 d	93 d			
Márgen: Mínima	-0.02	-0.04			
Máxima	-0.01	0.00			
Promedio	-0.02	-0.02			
Saldo	14 470.6	15 170.6	15 170.6	15 170.6	14 970.6
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 12 de Diciembre del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	1 818.8
Vencimientos de CDV BCRP del 5 al 9 de diciembre de 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	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 5 al 9 de diciembre de 2022					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 100.0	500.0			
Propuestas recibidas	1 573.5	1 367.5			
Plazo de vencimiento	1 d	1 d			
Tasas de interés: Mínima	6.15	6.25			
Máxima	7.00	6.33			
Promedio	6.50	6.28			
Saldo	1 100.0	500.0	0.0	0.0	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	1 100.0	500.0			
Vencimientos de Depósitos a Plazo del 5 al 9 de diciembre de 2022	1 100.0	500.0			
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	205.9				300.0
Propuestas recibidas	305.9				567.5
Plazo de vencimiento	182 d				182 d
Tasas de interés: Mínima	7.47				7.77
Máxima	8.01				8.01
Promedio	7.81				7.80
Saldo	6 495.8	6 495.8	6 495.8	6 495.8	6 495.8
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 5 de Diciembre del 2022	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 5 al 9 de diciembre de 2022	300.0	300.0	300.0	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 5 al 9 de diciembre de 2022					
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	0.0	0.0	0.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP					
Vencimiento de CDR BCRP del 5 al 9 de diciembre de 2022					
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 5 al 9 de diciembre de 2022					
xvi. Contora con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)			200.0	700.0	700.0
Propuestas recibidas			400.0	996.0	1596.0
Plazo de vencimiento			7 d	6 d	15 d
Tasas de interés: Mínima			8.00	7.90	7.95
Máxima			8.00	8.10	8.05
Promedio			8.00	8.02	7.79
Saldo	1 912.0	1 912.0	2 112.0	2 812.0	3 012.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 7 de Diciembre del 2022	500.0	500.0	500.0	500.0	1 200.0
Vencimiento de REPO del 5 al 9 de diciembre de 2022	500.0	500.0	500.0	500.0	1 200.0
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 5 al 9 de diciembre de 2022					
xviii. Contora 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 5 al 9 de diciembre de 2022					
xix. Contora 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 5 al 9 de diciembre de 2022					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		200.0	300.0 200.0	200.0	200.0 200.0 200.0 64.0
Propuestas recibidas		561.0	680.0 410.0	260.0	280.0 590.0 365.0 64.0
Plazo de vencimiento		91 d	272 d 272 d	274 d	273 d 90 d 273 d 90 d
Tasas de interés: Mínima		3.80	4.75 4.72	4.70	4.75 3.95 4.78 4.19
Máxima		3.85	4.79 4.77	4.78	4.85 3.95 4.85 4.40
Promedio		3.88	4.78 4.76	4.74	4.78 3.95 4.81 4.21
Saldo	39 000.0	39 200.0	39 099.9	38 699.9	38 563.9
Próximo vencimiento de SF-Venta el 5 de Diciembre del 2022	600.1	600.1	600.0	800.0	780.0
Vencimiento de SF - Venta del 5 al 9 de diciembre de 2022	2 000.1	2 000.1	1 400.0	800.0	1 130.0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 5 al 9 de diciembre de 2022					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés	30.0	Desierta			30.0
Propuestas recibidas	90.0				110.0
Plazo de vencimiento	92 d	181 d			274 d
Tasas de interés: Mínima	7.20				7.06
Máxima	7.20				7.06
Promedio	7.20				7.06
Saldo	2 840.1	2 810.1	2 760.1	2 760.1	2 790.1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 4 de Diciembre del 2022	30.0	50.0	50.0	50.0	50.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 5 al 9 de diciembre de 2022	80.0	50.0	0.0	0.0	80.0
b. Liquid. Repos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)	13.7	0.0	0.6	0.0	0.0
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	3.6	0.0	0.2	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	3.8630	0.0000	3.8630	0.0000	0.0000
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.5
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.5
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0.0	0.0	128.1	0.0	-212.0
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	0.0	128.1	0.0	-212.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 985.6**	**1 880.0**	**3 261.9**	**2 915.2**	**11 266.3**
4. Operaciones monetarias del BCR con el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	0.0195%	0.0196%	0.0195%	0.0197%	0.0205%
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés					
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	838.7	623.6	1 944.6	5.9	35.0
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 827.1**	**1 236.4**	**1 317.3**	**12 009.3**	**11 291.3**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 338.1	12 248.5	12 101.0	11 987.4	19 310.4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TRMN) (*)	4.9	4.9	4.1	4.1	9.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 158.9	5 069.3	4 691.9	4 898.9	12 009.3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TRMN) (*)	2.0	2.0	1.6	1.7	6.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 332.5	1 265.5	1 010.6	1 203.8	1 411.4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.00 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.50 / 7.30	7.00 / 7.55 / 7.45	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.25 / 7.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	30.0	38.0	6.0	-	3.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	4.00 / 4.00 / 4.00	4.00 / 4.00 / 4.00	4.00 / 4.00 /4.00	- / - / -	4.00 / 4.00 / 4.00
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$)	**Nov.25 2022**	**Nov.28 2022**	**Nov.29 2022**	**Nov.30 2022**	**Dic.01 2022**
Flujo de la posición diaria: = a + b.i - c.i + e + f + g	40.3	17.8	15.0	-28.5	-48.4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-37.3	44.5	24.4	9.9	25.1
a. Mercado spot con el público	-31.6	38.4	57.2	-32.8	52.9
i. Compras	482.7	640.7	569.4	474.8	446.6
ii. (-) Ventas	514.3	602.2	512.2	507.6	393.8
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	17.4	-135.5	83.9	36.0	-117.2
i. Pactadas	144.4	224.9	115.1	248.9	117.9
ii. (-) Vencidas	127.0	360.4	31.2	213.0	235.1
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-38.7	-108.6	146.3	56.5	-138.8
i. Pactadas	292.7	321.6	309.9	393.3	321.8
ii. (-) Vencidas	331.4	430.2	163.6	336.8	460.6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	340.0	253.2	404.7	466.6	376.4
ii. A futuro	30.0	0.0	141.0	30.0	38.0
e. Operaciones sect asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	201.5	84.8	115.0	168.2	201.1
i. Compras	317.6	425.1	140.6	334.4	434.9
ii. (-) Ventas	116.0	340.5	25.6	166.2	233.9
f. Efecto de Opciones	0.2	0.2	0.9	0.0	0.1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	18.5	-8.7	36.8	-19.6	-98.5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.8699	3.8532	3.8422	3.8538	3.8260
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera