BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	18 Set 23	19 Set 23	20 Set 23	21 Set 23	22 Set 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**9 795,1**	**10 119,3**	**8 829,7**	**8 869,5**	**6 773,7**
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)	500.0 200.0	500.0 200.0	300.0 100.0	300.0 100.0	300.0 100.0
Procuestas recibidas	810.0 720.0	991.0 485.0	861.3 415.0	804.0 375.0	972.0 370.0
Plazo de vencimiento	182 d 366 d	181 d 365 d	182 d 364 d	181 d 363 d	181 d 363 d
Tasas de interés: Mínima	6.93 6.25	7.00 6.34	7.03 6.34	7.00 6.33	7.01 6.29
Máxima	7.08 6.40	7.06 6.45	7.04 6.36	7.03 6.34	7.03 6.34
Promedio	7.03 6.39	7.04 6.39	7.03 6.35	7.03 6.34	7.02 6.32
Saldo	33 312.8	32 565.3	33 171.9	32 123.9	32 527.6
Próximo vencimiento de CD BCRP el 25 de Setiembre del 2023	1 888.5	1 764.0	1 764.0	200.0	1 470.0
Vencimiento de CD BCRP del 25 al 29 de setiembre de 2023	3 852.5	1 964.0	1 964.0	200.0	1 470.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					350.0
Procuestas recibidas					740.0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					7.50
Máxima					7.56
Promedio					7.52
Saldo	13 742.2	13 742.2	13 742.2	13 742.2	13 492.2
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 29 de Setiembre del 2023	600.0	600.0	600.0	600.0	600.0
Vencimiento de Reco Valores del 25 al 29 de setiembre de 2023	600.0	600.0	600.0	600.0	600.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Procuestas 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 25 al 29 de setiembre de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 300.8	6 300.8	6 300.8	6 300.8	6 300.8
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 3 de Octubre del 2023	2.7	2.7	2.7	2.7	2.7
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 25 al 29 de setiembre 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					
Procuestas 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					
Procuestas 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)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR					
Vencimiento de Reco Especial - CDR del 25 al 29 de setiembre de 2023					
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acceso de Liquidez					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez					
Vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez del 25 al 29 de setiembre de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDV BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 25 al 29 de setiembre de 2023					
x. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP					
Vencimiento de CDLD BCRP del 25 al 29 de setiembre de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 000.0 4 045.5	4 000.1 3 105.8	3 000.0 3 700.0	4 000.0 3 017.5	3 000.0 2 081.8
Procuestas recibidas	5 267.1 4 045.5	6 318.6 3 105.8	6 224.6 3 796.8	5 944.7 3 017.5	5 266.4 2 081.8
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	6.95 6.99	7.00 6.99	7.05 3.00	7.09 7.08	7.10 7.10
Máxima	7.21 7.48	7.20 7.49	7.17 7.50	7.40 7.50	7.25 7.50
Promedio	7.17 7.14	7.17 7.21	7.15 7.39	7.14 7.41	7.20 7.40
Saldo	7 045.5	7 105.9	6 700.0	7 017.5	5 081.8
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 25 de Setiembre del 2023	7 045.5	7 105.9	6 700.0	7 017.5	5 081.8
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 25 al 29 de setiembre de 2023	7 045.5	7 105.9	6 700.0	7 017.5	5 081.8
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 769.4	6 769.4	6 769.4	6 769.4	6 769.4
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 10 de Octubre del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 25 al 29 de setiembre 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					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN del 25 al 29 de setiembre de 2023					
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					300.0 230.0
Procuestas recibidas					600.0 500.0
Plazo de vencimiento					91 d 91 d
Tasas de interés: Mínima					5.93 5.68
Máxima					5.93 5.70
Promedio					5.33 5.68
Saldo	280.0	280.0	280.0	280.0	810.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 3 de Noviembre del 2023	130.0	130.0	130.0	130.0	130.0
Vencimiento de CDR BCRP del 25 al 29 de setiembre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Reconocación Reatrimoda (CDBCRP-NR)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 25 al 29 de setiembre de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	757.0	757.0	757.0	757.0	757.0
Próximo vencimiento de Repo Bancos el 27 de Setiembre del 2023	25.0	25.0	25.0	25.0	25.0
Vencimiento de REPO del 25 al 29 de setiembre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	25.0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco					
Vencimiento de REPO del 25 al 29 de setiembre de 2023					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Excansion					
Vencimiento de REPO Excansión del 25 al 29 de setiembre de 2023					
xix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 25 al 29 de setiembre de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			300.0	200.0 200.0	200.0 200.0 200.0
Procuestas recibidas			915.0	680.0 527.0	732.0 1073.0 715.0
Plazo de vencimiento			366 d	365 d 365 d	367 d 367 d 367 d
Tasas de interés: Mínima			5.46	5.51 5.69	5.44 5.30 5.59
Máxima			5.53	5.60 5.79	5.59 5.43 5.57
Promedio			5.51	5.53 5.74	5.48 5.37 5.46
Saldo	35 755.2	35 755.2	36 055.2	36 455.2	36 855.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 29 de Setiembre del 2023	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de SC - Venta del 25 al 29 de setiembre de 2023	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
xxi. Subasta de Reco de Valores sara orower dólares (RED)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0				
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 25 al 29 de setiembre de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0				
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés					
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 25 al 29 de setiembre de 2023					
b. Losat. Reros 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	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
i. Compras (millones de US$)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
Tipo de cambio promedio	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
ii. Ventas (millones de US$)	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$)	3.9	2.3	5.2	0.1	0.6
i. Compras (millones de US$)	3.9	2.3	5.2	0.1	0.6
ii. Ventas (millones de US$)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRPNR y RTP	69.8	0.0	77.5	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	69.8	0.0	77.5	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 972.8**	**3 299.3**	**2 536.0**	**2 439.9**	**2 197.8**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por reposición monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	100.0	304.0	205.0	682.0	650.3
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2 972.8**	**2 995.3**	**2 331.0**	**1 757.9**	**1 497.4**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	15 217.0	14 920.3	12 389.4	14 383.2	14 097.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.4	7.2	6.0	7.0	6.8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 308.6	8 011.8	7 763.1	7 474.7	7 188.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.0	3.9	3.8	3.6	3.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	811.4	599.7	505.3	590.0	482.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.50 / 7.50 / 7.50	7.50 / 7.50 / 7.50	7.50 / 7.50 / 7.50	7.50 / 7.50 / 7.50	7.50 / 7.50 / 7.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	116.0	82.0	121.0	83.0	81.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5.50 / 5.50 / 5.47	5.50 / 5.50 / 5.48	5.50 / 5.50 / 5.47	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRPNR y RTP					
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$)	**Set.15 2023**	**Set.18 2023**	**Set.19 2023**	**Set 20 2023**	**Set 21 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	57.1	-6.0	40.0	-133.3	44.2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	3.3	-38.8	1.7	-2.6	32.5
a. Mercado spot con el público	16.1	-0.9	64.0	-0.6	-52.8
i. Compras	403.9	856.5	647.8	370.5	551.1
ii. (-) Ventas	387.9	856.4	583.8	371.1	603.9
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	55.5	-421.3	2.0	-27.7	-367.2
i. Pactadas	123.8	106.1	427.3	148.6	270.2
ii. (-) Vencidas	68.3	527.3	425.3	176.3	637.4
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	53.3	-454.5	-38.2	183.4	-281.1
i. Pactadas	220.1	211.3	529.1	398.0	463.6
ii. (-) Vencidas	166.8	665.8	567.3	214.6	744.7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	629.4	252.4	396.9	319.3	710.5
ii. A futuro	0.0	120.0	17.0	98.0	89.0
e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	92.3	109.3	84.6	42.3	193.7
i. Compras	155.7	632.8	477.7	212.3	729.7
ii. (-) Ventas	63.4	523.5	393.1	170.0	536.0
f. Efecto de Opciones	-2.2	-0.3	-1.9	-0.2	-9.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	47.2	-8.9	-4.8	74.6	105.7
h. Crédito por reposición monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7221	3.7093	3.7144	3.7160	3.7432
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera