BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	13 Nov 23	14 Nov 23	15 Nov 23	16 Nov 23	17 Nov 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 531,0**	**8 953,4**	**10 823,1**	**11 470,2**	**10 109,9**
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)			300.0	400.0 200.0	500.0
Procuestas recibidas			1027.0	1295.0 614.0	1550.0
Plazo de vencimiento			182 d	181 d 92 d	180 d
Tasas de interés: Mínima			6.40	6.46 6.45	6.45
Máxima			6.58	6.55 6.78	6.52
Promedio			6.52	6.52 6.70	6.51
Saldo	31 534.6	31 534.6	31 839.1	31 390.9	39 516.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de Noviembre del 2023	1 500.0	1 500.0	1 500.0	1 625.0	876.2
Vencimiento de CD BCRP del 20 al 24 de noviembre de 2023	3 125.0	3 125.0	3 125.0	1 625.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)		500.0 500.0			50.0
Procuestas recibidas		1600.0 1050.0 950.0			775.0
Plazo de vencimiento		7 d 7 d 30 d			91 d
Tasas de interés: Mínima		7.17 7.21 7.36			6.90
Máxima		7.17 7.21 7.36			6.90
Promedio		7.17 7.21 7.36			6.90
Saldo	10 567.1	12 067.1	12 067.1	12 067.1	11 517.1
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 21 de Noviembre del 2023	600.0	600.0	600.0	600.0	1 000.0
Vencimiento de Reco Valores del 20 al 24 de noviembre de 2023	600.0	600.0	600.0	600.0	1 600.0
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 20 al 24 de noviembre de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 297.8	6 297.8	6 297.8	6 297.8	6 297.8
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 3 de Enero del 2024	14.1	14.1	14.1	14.1	14.1
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 20 al 24 de noviembre 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 20 al 24 de noviembre 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 Reco de Cartera para el Acceso de Liquidez					
Vencimiento de Reco de Cartera para el Acceso de Liquidez del 20 al 24 de noviembre de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Ajustables del BCR (CDV BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 20 al 24 de noviembre 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 20 al 24 de noviembre de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 200.0	1 300.0	3 400.0	3 000.1 2 605.1	3 000.1 3 900.0
Procuestas recibidas	2 737.0	2 956.0	5 696.7	3 029.1 2 605.1	4 805.3 3 980.4
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	6.35	6.30	6.30	6.35 6.40	6.35 6.50
Máxima	6.64	6.49	6.64	7.00 7.00	7.00 7.00
Promedio	6.61	6.47	6.48	6.77 6.66	6.61 6.93
Saldo	1 200.0	1 300.0	3 400.0	5 605.2	6 900.1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 20 de Noviembre del 2023	1 200.0	1 300.0	3 400.0	5 605.2	6 900.1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 20 al 24 de noviembre de 2023	1 200.0	1 300.0	3 400.0	5 605.2	6 900.1
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0			300.0	300.0
Procuestas recibidas	675.1			672.9	412.2
Plazo de vencimiento	35 d			33 d	33 d
Tasas de interés: Mínima	7.18			7.13	7.06
Máxima	7.26			7.48	7.20
Promedio	7.22			7.23	7.11
Saldo	6 232.8	6 232.8	6 232.8	6 332.8	6 332.8
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 22 de Noviembre del 2023	200.0	200.0	200.0	300.0	158.1
Vencimiento de Coloc-TP del 20 al 24 de noviembre de 2023	500.0	500.0	500.0	300.0	158.1
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 20 al 24 de noviembre de 2023					
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 828.0	1 828.0	1 828.0	1 828.0	1 828.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 21 de Diciembre del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de CDR BCRP del 20 al 24 de noviembre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)					
Procuestas 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 noviembre de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	292.0	292.0	292.0	292.0	292.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 28 de Noviembre del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de REPO del 20 al 24 de noviembre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 20 al 24 de noviembre 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 Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 20 al 24 de noviembre 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 Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 20 al 24 de noviembre de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	90.0 50.0 145.0 120.0	160.0	300.0 200.0	300.0	200.0 142.5 200.0
Procuestas recibidas	330.0 90.0 195.0 160.0	350.0	835.0 280.0	791.0	230.0 150.0 310.0
Plazo de vencimiento	92 d 182 d 274 d 274 d	92 d	92 d 274 d	92 d	90 d 182 d 273 d
Tasas de interés: Mínima	5.81 5.85 5.80 5.84	5.83	5.78 5.84	5.69	5.78 5.78 5.72
Máxima	5.84 5.85 5.89 5.89	5.85	5.85 5.89	5.79	5.80 5.94 5.89
Promedio	5.83 5.85 5.85 5.88	5.84	5.82 5.88	5.72	5.79 5.85 5.85
Saldo	44 982.4	44 862.4	45 162.4	45 462.4	45 204.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 22 de Noviembre del 2023	280.0	200.0	800.0	800.0	400.0
Vencimiento de SC - Venta del 20 al 24 de noviembre de 2023	1 280.0	1 000.0	800.0	800.0	1 000.1
xxi. Subasta de Reco de Valores para proveer dólares (RED)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 20 al 24 de noviembre de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés					
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 20 al 24 de noviembre de 2023					
b. Liquid. Repos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
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$)	2.9	11.6	-21.2	0.0	3.7
i. Compras (millones de US$)	2.9	11.6	0.0	0.0	3.7
ii. Ventas (millones de US$)	n.n	n.n	21.2	n.n	n.n
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	86.9	0.0	90.2	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	86.9	0.0	90.2	0.0	0.0
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**7 916,0**	**9 970,3**	**8 090,3**	**6 669,2**	**4 274,2**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0201%	0.0201%	0.0201%	0.0201%	0.0201%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	331.0	363.0	367.0	436.0	499.0
Tasa de interés	4.25%	4.25%	4.25%	4.25%	4.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**7 585,0**	**9 307,9**	**7 723,3**	**6 173,2**	**3 775,2**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	15 846.4	15 674.8	15 785.1	15 598.4	15 338.5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	7.7	7.6	7.6	7.5	7.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	9 286.4	9 114.8	9 229.0	9 042.1	8 782.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	4.5	4.4	4.4	4.4	4.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 343.0	1 197.0	761.5	618.0	602.9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.00 / 7.00 / 7.00	7.00 / 7.35 / 7.10	6.85 / 7.00 / 7.00	7.00 / 7.00 / 7.00	7.00 / 7.00 / 7.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	52.0	82.0	47.0	93.0	194.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	n.n / n.n / n.n	n.n / n.n / n.n	n.n / n.n / n.n	n.n / n.n / n.n	n.n / n.n / n.n
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CTS					
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.10 2023**	**Nov.13 2023**	**Nov.14 2023**	**Nov.15 2023**	**Nov.16 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + o	-3.3	-15.1	25.8	-36.7	68.7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + o	29.5	-95.8	10.6	-156.6	76.6
a. Mercado spot con el público	38.2	-54.0	20.8	-149.5	73.9
i. Compras	470.2	605.0	755.4	357.2	636.3
ii. (-) Ventas	432.0	659.0	734.6	506.7	562.4
b. Compras forward y swap al público (con v sin entrega)	-217.1	128.9	13.2	129.8	-199.9
i. Pactadas	92.1	226.6	314.3	515.8	316.9
ii. (-) Vencidas	309.2	97.7	301.2	386.0	516.8
c. Ventas forward v swap al público (con y sin entrega)	-112.6	-7.6	-11.0	85.4	-108.9
i. Pactadas	310.5	722.0	334.1	344.6	718.5
ii. (-) Vencidas	423.1	729.5	345.1	259.2	827.4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	878.4	651.1	511.3	694.4	794.3
ii. A futuro	70.0	134.0	17.0	64.0	145.0
e. Operaciones swap asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entregas	112.1	592.6	43.5	-131.2	310.1
i. Compras	420.4	685.2	343.3	251.3	823.6
ii. (-) Ventas	308.3	92.6	299.8	382.5	513.5
f. Efecto de Opciones	-10.8	1.9	21.1	-2.5	1.6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	75.6	-60.3	-39.9	75.2	82.8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.8140	3.8114	3.7671	3.7723	3.7694

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera