BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	14 Nov 22	15 Nov 22	16 Nov 22	17 Nov 22	18 Nov 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**2,619.2**	**3,893.9**	**4,492.1**	**5,254.6**	**3,872.6**
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)					
Propuestas recibidas				300.0	300.0
Plazo de vencimiento				1087.0	979.7
				181 d	181 d
Tasas de interés: Mínima				7.00	7.10
Máxima				7.30	7.25
Promedio				7.22	7.20
Saldo	11,204.4	11,204.4	11,204.4	11,764.4	11,504.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de Enero del 2023	710.0	710.0	710.0	710.0	380.0
Vencimiento de CD BCRP del 21 al 25 de noviembre de 2022	710.0	710.0	710.0	710.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2000.0 800.0	1000.0 500.0	400.0		300.0
Propuestas recibidas	4870.0 2670.0	1620.0 1025.0	500.0		1060.0
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 30 d	1 d		94 d
Tasas de interés: Mínima	7.38 7.55	7.75 7.61	7.26		7.82
Máxima	7.47 7.68	7.75 7.76	7.26		8.13
Promedio	7.41 7.64	7.75 7.66	7.26		8.01
Saldo	12,458.4	11,158.4	10,558.4	9,858.4	10,158.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 25 de Noviembre del 2022	2,800.0	1,000.0	700.0	600.0	600.0
Vencimiento de Repo Valores del 21 al 25 de noviembre de 2022	3,100.0	1,300.0	700.0	0.0	600.0
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 21 al 25 de noviembre 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 21 al 25 de noviembre 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 21 al 25 de noviembre de 2022					
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	3.0	3.0	3.0	0.0	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez	3.0	3.0	3.0	0.0	
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 21 al 25 de noviembre de 2022	3.0	3.0	3.0	0.0	
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)				499.9	499.9
Propuestas recibidas				1380.0	720.0
Plazo de vencimiento				92 d	91 d
Márgen: Mínima				-0.01	-0.01
Máxima				0.00	0.00
Promedio				-0.01	0.00
Saldo	17,000.7	15,430.7	15,430.7	14,936.0	15,685.9
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 24 de Noviembre del 2022	1,570.0	1,254.6	1,254.6	1,800.0	1,800.0
Vencimientos de CDV BCRP del 21 al 25 de noviembre de 2022	2,824.6	1,254.6	1,254.6	0.0	1,800.0
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 21 al 25 de noviembre de 2022					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)				800.0	1,900.0
Propuestas recibidas				3,128.7	2,155.5
Plazo de vencimiento				1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima				6.49	6.00
Máxima				6.80	6.90
Promedio				6.64	6.39
Saldo				800.0	1,900.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 21 de Noviembre del 2022				800.0	1,900.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 21 al 25 de noviembre de 2022				800.0	1,900.0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0		200.0		300.0
Propuestas recibidas	442.2		472.0		506.7
Plazo de vencimiento	182 d		181 d		181 d
Tasas de interés: Mínima	7.52		7.48		7.82
Máxima	7.90		8.11		8.00
Promedio	7.65		7.89		7.85
Saldo	6,795.5	6,795.5	6,695.5	6,695.5	6,695.5
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 21 de Noviembre del 2022	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 21 al 25 de noviembre de 2022	600.0	600.0	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 21 al 25 de noviembre 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					
Próximo vencimiento de CDR BCRP					
Vencimiento de CDR BCRP del 21 al 25 de noviembre 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 21 al 25 de noviembre de 2022					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)		500.0			
Propuestas recibidas		1148.0			
Plazo de vencimiento		7 d			
Tasas de interés: Mínima		7.77			
Máxima		7.99			
Promedio		7.84			
Saldo	1,912.0	2,412.0	2,412.0	2,412.0	2,412.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de Noviembre del 2022	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de REPO del 21 al 25 de noviembre de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	800.0
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 21 al 25 de noviembre de 2022					
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 21 al 25 de noviembre de 2022					
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 21 al 25 de noviembre de 2022					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0			250.0	
Propuestas recibidas	520.0			370.0	
Plazo de vencimiento	92 d			181 d	
Tasas de interés: Mínima	3.87			4.44	
Máxima	3.87			4.51	
Promedio	3.87			4.47	
Saldo	39,104.0	39,104.0	39,104.0	38,834.0	38,704.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 21 de Noviembre del 2022	520.0	520.0	520.0	130.0	100.0
Vencimiento de SC - Venta del 21 al 25 de noviembre de 2022	650.0	650.0	650.0	130.0	1.504.0
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 21 al 25 de noviembre de 2022					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés	30.0	30.0			Desierta
Propuestas recibidas	55.0	100.0			- -
Plazo de vencimiento	92 d	181 d			273 d
Tasas de interés: Mínima	7.10	7.15			0.00
Máxima	7.25	7.15			0.00
Promedio	7.23	7.15			0.00
Saldo	3,015.1	2,995.1	2,995.1	2,945.1	2,895.1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 22 de Noviembre del 2022	50.0	50.0	50.0	50.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 21 al 25 de noviembre de 2022	150.0	100.0	100.0	50.0	130.0
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	3.9
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	3.9
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	3.8310
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	208.5	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	8.5	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	200.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	174.4	0.0	71.0	0.0	145.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**5,719.2**	**5,885.9**	**5,003.3**	**3,863.1**	**2,590.7**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0201%	0.0196%	0.0196%	0.0196%	0.0205%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	620.2	1,062.6	2,184.8	1,860.0	836.0
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**5.099.0**	**4.823.3**	**2.818.5**	**2.003.1**	**1.754.7**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	15.631.3	15.446.4	15.213.9	14.789.1	14.432.7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.9	7.8	7.7	7.4	7.3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8.442.4	8.267.7	8.035.2	7.610.4	7.253.6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.2	4.2	4.0	3.8	3.7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	2,217.6	2,013.8	1,760.9	2,609.5	2,388.1
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.25 / 7.25 / 7.28	7.25 / 7.40 / 7.27	6.75 / 7.30 / 7.25	7.25 / 7.30 / 7.25	7.25 / 7.50 / 7.26
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	10.0	8.0	9.8	44.8	5.0
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	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.11 2022**	**Nov.14 2022**	**Nov.15 2022**	**Nov.16 2022**	**Nov.17 2022**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-23.9	73.6	51.1	-28.8	75.6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-47.6	-152.5	-108.1	-73.4	-45.2
a. Mercado spot con el público	-46.1	-157.6	-95.0	-93.0	-43.8
i. Compras	348.9	824.0	658.6	485.6	485.1
ii. (-) Ventas	395.0	981.6	753.6	578.6	528.9
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	139.5	191.0	202.6	126.4	-112.2
i. Pactadas	142.8	472.0	418.4	267.7	301.7
ii. (-) Vencidas	3.2	281.0	215.7	141.2	413.8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	116.9	-6.1	44.3	82.6	-298.6
i. Pactadas	121.2	221.2	366.9	214.7	460.9
ii. (-) Vencidas	4.3	227.2	322.6	132.1	759.5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	335.6	1051.1	643.2	602.5	330.5
ii. A futuro	40.0	86.0	107.0	40.0	40.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	0.8	-47.4	101.3	20.8	348.2
i. Compras	1.1	226.6	316.0	130.9	755.0
ii. (-) Ventas	0.3	274.0	214.7	110.1	406.8
f. Efecto de Opciones	1.1	2.1	1.0	0.7	-0.8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-1.1	25.7	-7.6	-10.3	-68.8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.8551	3.8621	3.8290	3.8407	3.8413
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera