BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	11 Set 23	12 Set 23	13 Set 23	14 Set 23	15 Set 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**9 011,6**	**9 243,7**	**9 847,3**	**10 749,9**	**9 769,9**
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)		500.0	500.0 200.0	500.0 200.0	500.0 200.0
Propuestas recibidas		1314.7	1429.0 694.0	1481.7 338.5	1310.0 595.0
Plazo de vencimiento		182 d	181 d 366 d	182 d 365 d	181 d 364 d
Tasas de interés: Mínima		7.04	7.00 6.58	7.00 6.44	6.97 6.10
Máxima		7.16	7.15 6.60	7.14 6.59	7.08 6.53
Promedio		7.13	7.13 6.59	7.13 6.57	7.04 6.35
Saldo	33 206.7	33 859.4	33 478.7	33 028.7	32 338.8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 19 de Setiembre del 2023	1 680.7	1 680.7	1 500.0	1 799.9	1 888.5
Vencimiento de CD BCRP al 18 al 22 de setiembre de 2023	4 980.6	4 980.6	3 299.9	1 799.9	3 852.5
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					200.0
Propuestas recibidas					700.0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					7.52
Máxima					7.52
Promedio					7.52
Saldo	14 143.4	14 143.4	14 142.2	14 142.2	13 742.2
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 22 de Setiembre del 2023	1.2	1.2	600.0	600.0	600.0
Vencimiento de Repo Valores al 18 al 22 de setiembre de 2023	601.2	601.2	600.0	600.0	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 al 18 al 22 de setiembre de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 300.8	6 300.8	6 300.8	6 300.8	6 300.8
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 3 de Octubre del 2023	2.7	2.7	2.7	2.7	2.7
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo al 18 al 22 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					
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 al 18 al 22 de setiembre 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 al 18 al 22 de setiembre de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Márgen: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP al 18 al 22 de setiembre de 2023					
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 al 18 al 22 de setiembre de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)		1 400.0	2 000.0 1 600.0	2 000.0 3 300.0	3 000.0 3 300.0
Propuestas recibidas		3 059.7	3 510.7 3 265.5	4 431.2 5 129.5	5 098.7 3 987.7
Plazo de vencimiento		1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima		6.50	7.16 7.00	7.08 7.18	7.00 6.85
Máxima		7.53	7.66 7.50	7.57 7.40	7.23 7.17
Promedio		7.43	7.59 7.43	7.45 7.30	7.19 7.08
Saldo		1 400.0	3 600.0	5 300.0	6 300.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 18 de Setiembre del 2023		1 400.0	3 600.0	5 300.0	6 300.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo al 18 al 22 de setiembre de 2023		1 400.0	3 600.0	5 300.0	6 300.0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas 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 al 18 al 22 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					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN al 18 al 22 de setiembre 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	280.0	280.0	280.0	280.0	280.0
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 al 18 al 22 de setiembre 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)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP al 18 al 22 de setiembre de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas 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 Regular el 27 de Setiembre del 2023	25.0	25.0	25.0	25.0	25.0
Vencimiento de REPO al 18 al 22 de setiembre 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 Repo					
Vencimiento de REPO al 18 al 22 de setiembre 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 al 18 al 22 de setiembre 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 al 18 al 22 de setiembre de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				300.0	200.0
Propuestas recibidas				755.0	200.0
Plazo de vencimiento				182 d	367 d
Tasas de interés: Mínima				5.60	5.55
Máxima				5.69	5.80
Promedio				5.62	5.63
Saldo	35 255.2	35 255.2	35 255.2	35 555.2	35 755.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 22 de Setiembre del 2023	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de SC - Venta al 18 al 22 de setiembre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	200.0
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 al 18 al 22 de setiembre de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 16 de Setiembre del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés al 18 al 22 de setiembre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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	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$)	3.7	0.0	0.4	1.4	17.4
i. Compras (millones de US$)	3.7	0.0	0.4	1.4	17.4
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	72.6	0.0	77.6	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	72.6	0.0	77.6	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**9 011.6**	**7 676.6**	**6 177.7**	**5 187.1**	**3 872.6**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%	0.0221%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 195.0	506.0	326.0	730.0	797.0
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**7 816.6**	**7 170.6**	**5 851.7**	**4 457.1**	**3 075.6**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	17 936.0	17 549.3	17 233.3	16 811.8	16 355.7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8.7	8.5	8.4	8.1	7.9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	11 017.9	10 632.4	10 316.5	9 903.3	9 447.3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.3	5.2	5.0	4.8	4.6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	980.0	943.0	764.8	705.0	1 032.4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.50 / 7.50 / 7.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	110.0	131.0	130.0	194.0	174.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50	5.29 / 5.50 / 5.48
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$)	**Set.08 2023**	**Set.11 2023**	**Set.12 2023**	**Set.13 2023**	**Set.14 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-95.6	-57.2	8.0	-6.4	29.6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	71,4	-67,8	80,0	-2,8	50,6
a. Mercado spot con el público	-23,5	-58,6	90,6	-7,6	48,0
i. Compras	519,2	404,7	484,6	273,7	648,7
ii. (-) Ventas	542,7	463,3	394,0	281,4	600,7
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	81,9	146,5	-16,5	215,1	-186,2
i. Pactadas	255,3	172,6	184,0	339,4	422,4
ii. (-) Vencidas	173,4	26,1	200,4	124,3	608,5
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	296,8	140,6	54,2	217,5	-85,9
i. Pactadas	477,3	246,0	762,3	481,6	816,2
ii. (-) Vencidas	180,5	105,4	708,1	264,1	902,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	634,3	247,5	394,9	500,0	466,1
ii. A futuro	0,0	0,0	151,0	210,0	69,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	97,0	74,0	500,1	149,0	298,6
i. Compras	178,8	95,4	700,4	260,3	896,9
ii. (-) Ventas	81,7	21,4	200,4	111,3	598,3
f. Efecto de Opciones	-6,0	4,8	-1,3	-1,2	-1,6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	58,9	-3,9	-3,0	-4,4	78,4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7155	3.6984	3.7060	3.7032	3.7113
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera