BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	23 Oct 23	24 Oct 23	25 Oct 23	26 Oct 23	27 Oct 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**7 971.3**	**6 565.2**	**5 834.8**	**6 394.6**	**4 900.3**
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)	700.0	500.0	300.0	300.0	300.0
Propuestas recibidas	1392.7	765.0	660.0	540.0	525.0
Plazo de vencimiento	182 d	183 d	92 d	91 d	90 d
Tasas de interés: Mínima	6.66	6.68	6.88	6.85	6.89
Máxima	6.70	6.69	6.91	6.90	6.90
Promedio	6.69	6.69	6.89	6.89	6.89
Saldo	31 432.5	31 934.5	32 234.5	32 534.5	32 984.5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Noviembre del 2023	1 899.9	1 899.9	1 899.9	1 899.9	1 899.9
Vencimiento de CD BCRP al 27 de octubre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					450.0
Propuestas recibidas					1200.0
Plazo de vencimiento					98 d
Tasas de interés: Mínima					7.30
Máxima					7.36
Promedio					7.32
Saldo	13 192.1	13 192.1	13 192.1	13 192.1	13 042.1
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 27 de Octubre del 2023	600.0	600.0	600.0	600.0	600.0
Vencimiento de Repo Valores al 27 de octubre de 2023	600.0	600.0	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 27 de octubre de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 297.8	6 297.8	6 297.8	6 297.8	6 297.8
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 3 de Enero del 2024	14.1	14.1	14.1	14.1	14.1
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo al 27 de octubre 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 27 de octubre 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 27 de octubre 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 27 de octubre 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 27 de octubre de 2023					
xi Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 000.0 2 430.5	2 500.0 2 100.0	2 000.0 2 500.0	2 000.0 2 700.0	2 000.0 2 025.3
Propuestas recibidas	3 903.0 2 430.5	3 654.7 2 302.5	3 592.8 2 679.0	3 295.5 2 923.0	2 028.1 2 025.3
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	6.70 6.98	6.90 6.55	6.85 7.00	6.90 7.00	6.90 7.00
Máxima	7.21 7.25	7.20 7.25	7.15 7.24	7.19 7.24	7.24 7.25
Promedio	6.98 7.16	7.05 7.17	7.11 7.15	7.11 7.18	7.14 7.16
Saldo	5 430.5	4 600.0	4 500.0	4 700.0	4 025.3
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 27 de Octubre del 2023	5 430.5	4 600.0	4 500.0	4 700.0	4 025.3
Vencimiento de Depósitos a Plazo al 27 de octubre de 2023	5 430.5	4 600.0	4 500.0	4 700.0	4 025.3
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					300.0
Propuestas recibidas					967.7
Plazo de vencimiento					31 d
Tasas de interés: Mínima					7.40
Máxima					7.68
Promedio					7.49
Saldo	6 253.6	5 953.6	5 953.6	5 953.6	5 953.6
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Octubre del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP al 27 de octubre de 2023	600.0	300.0	300.0	300.0	600.0
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 27 de octubre 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	2 108.0	2 108.0	2 108.0	2 108.0	2 108.0
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 27 de octubre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	130.0
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 27 de octubre de 2023					
xvi Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	347.0	347.0	347.0	347.0	317.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 27 de Octubre del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	25.0
Vencimiento de REPO al 27 de octubre de 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	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 27 de octubre 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 27 de octubre 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 27 de octubre de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					300.1 Desierta
Propuestas recibidas					660.0 - -
Plazo de vencimiento					94 d 94 d
Tasas de interés: Mínima					5.72 -
Máxima					5.74 -
Promedio					5.73 -
Saldo	43 649.2	43 799.2	44 249.2	43 979.3	43 729.4
Próximo vencimiento de SC-Venta el 27 de Octubre del 2023	800.0	670.0	589.9	550.0	500.0
Vencimiento de SC - Venta al 27 de octubre de 2023	2 609.9	1 809.9	1 139.9	550.0	2 099.9
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 27 de octubre de 2023					
xxii Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas 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 al 27 de octubre de 2023	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$)	0.0	0.0	4.7	0.4	4.3
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	4.7	0.4	4.3
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	73.7	0.0	68.2	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	73.7	0.0	68.2	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 809.3**	**2 453.5**	**2 087.7**	**2 385.9**	**2 157.3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0208%	0.0208%	0.0208%	0.0208%	0.0208%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	559.0	341.0	57.0	40.0	422.0
Tasa de interés	4.50%	4.50%	4.50%	4.50%	4.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2 250.3**	**2 112.5**	**2 030.7**	**2 345.9**	**1 735.3**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13 953.5	13 719.6	13 514.6	12 994.8	13 174.6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.7	6.6	6.5	6.5	6.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 333.9	7 100.0	6 895.0	6 629.8	6 555.0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.5	3.4	3.3	3.3	3.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 015.0	1 305.4	990.0	1 487.8	2 003.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.25 / 7.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	163.0	277.0	256.0	128.0	94.0
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	5.50 / 5.50 / 5.50
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$)	**Oct. 20 2023**	**Oct. 23 2023**	**Oct. 24 2023**	**Oct. 25 2023**	**Oct. 26 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-12.0	3.7	-63.8	105.9	-18.8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	26.8	-126.8	-151.3	-138.3	17.3
a. Mercado spot con el público	-56.5	-107.3	-133.3	-124.9	21.5
i. Compras	545.5	693.2	334.0	363.6	374.0
ii. (-) Ventas	602.0	800.5	467.3	488.5	352.4
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	201.4	87.8	-44.1	184.7	-14.0
i. Pactadas	262.9	388.2	275.2	473.6	295.2
ii. (-) Vencidas	61.5	300.4	319.3	288.9	309.1
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	311.5	-52.0	-104.8	56.0	-54.1
i. Pactadas	413.4	416.2	446.3	317.8	349.1
ii. (-) Vencidas	101.9	468.2	551.1	261.8	403.2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	280.7	219.4	328.1	606.5	402.4
ii. A futuro	30.0	40.0	23.0	140.0	154.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	51.7	161.5	225.7	-28.5	100.7
i. Compras	85.7	460.0	544.7	253.8	398.3
ii. (-) Ventas	34.0	298.5	319.0	282.2	297.5
f. Efecto de Opciones	-10.7	-3.2	0.0	3.5	-0.6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	154.1	-19.4	14.9	100.1	-86.5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.8746	3.8729	3.8633	3.8700	3.8695
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera