BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	20 Nov 23		21 Nov 23		22 Nov 23		23 Nov 23		24 Nov 23	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**10 360,9**		**8 041,6**		**6 956,7**		**6 298,9**		**4 228,8**	
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		500.0		300.1			
Procuestas recibidas	1072.0		1295.0		1335.0		765.0			
Plazo de vencimiento	183 d		182 d		183 d		182 d			
Tasas de interés: Mínima	6.48		6.47		6.47		6.46			
Máxima	6.50		6.49		6.48		6.47			
Promedio	6.50		6.48		6.47		6.46			
Saldo	31 286.0		32 016.0		32 691.0		33 013.1		33 013.1	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de Noviembre del 2023	876.2		876.2		876.2		876.2		876.2	
Vencimiento de CD BCRP del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023	0.0		0.0		0.0		0.0		876.2	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)									600.0	
Procuestas recibidas									925.0	
Plazo de vencimiento									91 d	
Tasas de interés: Mínima									6.90	
Máxima									6.90	
Promedio									6.90	
Saldo	11 517.1		10 517.1		10 517.1		10 517.1		10 517.1	
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 1 de Diciembre del 2023	1 000.0		600.0		600.0		600.0		600.0	
Vencimiento de Reco Valores del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023	1 600.0		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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023										
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 500.0 2 178.8		2 999.9 2 400.1		2 000.1 2 400.1		2 000.0 2 500.0		1 500.0 1 700.0	
Procuestas recibidas	4 713.9 2 178.8		4 527.5 3 259.6		4 702.0 3 424.8		4 604.5 3 260.3		2 698.0 2 542.5	
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	6.45 6.70		6.47 6.80		6.80 6.65		6.80 6.70		6.60 6.60	
Máxima	7.00 7.00		7.00 7.00		6.95 6.95		6.95 6.93		6.93 6.93	
Promedio	6.95 6.95		6.97 6.94		6.95 6.93		6.95 6.86		6.85 6.85	
Saldo	5 678.8		5 400.0		4 400.2		4 500.0		3 200.0	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 27 de Noviembre del 2023	5 678.8		5 400.0		4 400.2		4 500.0		3 200.0	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023	5 678.8		5 400.0		4 400.2		4 500.0		3 200.0	
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					200.0					
Procuestas recibidas					254.6					
Plazo de vencimiento					30 d					
Tasas de interés: Mínima					7.03					
Máxima					7.11					
Promedio					7.07					
Saldo	6 332.8		6 332.8		6 374.7		6 374.7		6 374.7	
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Noviembre del 2023	158.1		158.1		300.0		300.0		300.0	
Vencimiento de Coloc-TP del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023	158.1		158.1		0.0		0.0		636.9	
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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023	0.0		0.0		0.0		0.0		30.0	
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Reco										
Vencimiento de REPO del 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023										
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					163.0 Desierta				110.0 180.0 Desierta	
Procuestas recibidas					583.0 - -				210.0 180.0	
Plazo de vencimiento					92 d 92 d				91 d 273 d 91 d	
Tasas de interés: Mínima					5.74 -				5.78 5.89 -	
Máxima					5.84 -				5.84 5.90 -	
Promedio					5.78 -				5.81 5.89 -	
Saldo	45 204.9		45 204.9		44 967.9		44 967.9		44 657.8	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 28 de Noviembre del 2023	400.0		400.0		600.1		600.1		200.0	
Vencimiento de SC - Venta del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023	1 000.1		1 000.1		600.1		600.1		1 250.0	
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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023										
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	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$)	-97.4		4.3		0.0		2.3		0.6	
i. Compras (millones de US$)	0.0		4.3		0.0		2.3		0.6	
ii. Ventas (millones de US$)	97.4		n.n		n.n		n.n		n.n	
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	60.3		0.0		81.3		0.0		0.0	
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP (Vencimiento)	60.3		0.0		81.3		0.0		0.0	
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**5 452,6**		**3 489,7**		**3 392,0**		**2 416,8**		**2 742,3**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).										
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0201%		0.0201%		0.0201%		0.0201%		0.0201%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
Tasa de interés										
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 160.0		42.0		516.0		323.0		785.0	
Tasa de interés	4.25%		4.25%		4.25%		4.25%		4.25%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**4 292,6**		**3 417,7**		**2 798,9**		**2 093,8**		**1 957,3**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	14 467.5		14 319.8		14 082.5		13 848.9		13 603.5	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.0		6.9		6.8		6.7		6.6	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 911.2		7 763.5		7 526.2		7 292.6		7 047.2	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.8		3.8		3.6		3.5		3.4	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	743.4		1 249.3		1 097.2		1 069.7		841.9	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.00 / 7.00 / 7.00		7.00 / 7.00 / 7.00		6.90 / 7.00 / 6.99		7.00 / 7.00 / 7.00		7.00 / 7.00 / 7.00	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	82.2		56.0		17.0		109.0		70.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	S/ 0.0 / S/ 0.0 / S/ 0.0		S/ 0.0 / S/ 0.0 / S/ 0.0		S/ 0.0 / S/ 0.0 / S/ 0.0		S/ 0.0 / S/ 0.0 / S/ 0.0		S/ 0.0 / S/ 0.0 / S/ 0.0	
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.17 2023**		**Nov.20 2023**		**Nov.21 2023**		**Nov.22 2023**		**Nov.23 2023**	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	117.4		-147.3		125.1		-0.1		-26.8	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	76.3		-55.0		-42.2		-183.7		60.0	
a. Mercado spot con el público	95.7		-65.1		-37.1		-174.2		61.2	
i. Compras	358.5		466.7		416.5		527.8		401.8	
ii. (-) Ventas	260.9		515.8		453.6		702.0		340.6	
b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega)	143.7		58.8		-134.7		-433.1		41.9	
i. Pactadas	202.3		216.6		486.9		374.4		75.3	
ii. (-) Vencidas	58.7		157.8		621.6		807.5		33.4	
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	29.8		160.7		-300.2		-680.0		131.7	
i. Pactadas	266.2		391.5		362.3		379.2		220.3	
ii. (-) Vencidas	236.4		230.8		662.6		1059.2		88.6	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	401.1		288.7		523.1		591.6		211.4	
ii. A futuro	0.0		20.0		45.0		80.0		0.0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps o vencimientos de forwards sin entrega	168.9		72.8		41.0		298.5		54.3	
i. Compras	220.2		215.4		662.3		1049.0		87.3	
ii. (-) Ventas	51.3		142.6		621.3		792.4		33.1	
f. Efecto de Opciones	-0.3		9.6		1.7		-0.4		3.0	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-83.0		-5.7		-5.1		-77.4		-0.3	
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7716		3.7387		3.7424		3.7429		3.7348	

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera