BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	04 Dic 23	05 Dic 23	06 Dic 23	07 Dic 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**6 200,8**	**7 128,7**	**7 378,2**	**5 325,1**
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				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	33 211.6	33 211.6	33 211.6	33 211.6
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Diciembre del 2023	1 500.0	1 500.0	1 500.0	1 500.0
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 15 de diciembre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2000.0 500.0 3930.0	2000.0 1700.0	1500.0 360.0	1500.0 500.0 1095.0
Propuestas recibidas	3380.0 1345.0 3930.0	2188.0 2090.0	1665.0 360.0	1500.0 950.0 1095.0
Plazo de vencimiento	1 d 31 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	4 d 32 d 4 d
Tasas de interés: Mínima	7.04 7.02 7.0	7.03 7.01	7.02 7.02	7.02 7.0 7.01
Máxima	7.06 7.11 7.06	7.09 7.05	7.07 7.04	7.06 7.0 7.05
Promedio	7.05 7.05 7.03	7.06 7.03	7.04 7.03	7.04 7.0 7.03
Saldo	17 647.1	15 417.1	13 577.1	13 822.1
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 11 de Diciembre del 2023	5 930.0	3 700.0	2 850.0	3 195.0
Vencimiento de Repo Valores del 11 al 15 de diciembre de 2023	6 920.0	4 690.0	2 850.0	0.0
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 11 al 15 de diciembre 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
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 3 de Enero del 2024	14.1	14.1	14.1	14.1
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 11 al 15 de diciembre de 2023	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
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
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 11 al 15 de diciembre 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 del 11 al 15 de diciembre 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 del 11 al 15 de diciembre 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 del 11 al 15 de diciembre de 2023				
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo				
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 11 al 15 de diciembre de 2023				
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	119.6	300.0	220.0	
Propuestas recibidas	425.0	662.2	545.0	
Plazo de vencimiento	31 d	31 d	33 d	
Tasas de interés: Mínima	7.00	7.00	6.88	
Máxima	7.09	7.06	7.01	
Promedio	7.06	7.02	6.97	
Saldo	6 130.4	6 130.4	6 150.4	5 850.4
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 11 de Diciembre del 2023	300.0	200.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 11 al 15 de diciembre de 2023	800.0	500.0	300.0	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 del 11 al 15 de diciembre 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	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
Vencimiento de CDR BCRP del 11 al 15 de diciembre de 2023	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 del 11 al 15 de diciembre de 2023				
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	262.0	262.0	262.0	262.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de Diciembre del 2023	20.0	20.0	20.0	20.0
Vencimiento de REPO del 11 al 15 de diciembre de 2023	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 del 11 al 15 de diciembre 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 del 11 al 15 de diciembre 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 del 11 al 15 de diciembre de 2023				
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300.0	200.0	300.0 300.0 250.0	300.0 170.0
Propuestas recibidas	656.0	700.0	1156.0 1003.0 600.0	760.0 610.0
Plazo de vencimiento	275 d	183 d	183 d 275 d 183 d	183 d 277 d
Tasas de interés: Mínima	5.70	5.82	5.77 5.63 5.80	5.80 5.85
Máxima	5.71	5.89	5.80 5.72 5.95	5.93 5.89
Promedio	5.71	5.86	5.79 5.67 5.89	5.85 5.88
Saldo	44 547.8	44 547.8	44 697.8	44 669.8
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de Diciembre del 2023	200.0	700.0	498.0	300.0
Vencimiento de SC - Venta del 11 al 15 de diciembre de 2023	1 398.0	1 198.0	498.0	0.0
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 11 al 15 de diciembre de 2023				
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés				
Propuestas 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 11 al 15 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	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	-0.7	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.4	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	1.1	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	49.6	0.0	49.6	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP (Valorizado)	49.6	0.0	49.6	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**12 683.4**	**11 126.7**	**9 458.2**	**8 420.1**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0201%	0.0201%	0.0201%	0.0201%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés				
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	448.0	326.0	375.0	303.0
Tasa de interés	4.25%	4.25%	4.25%	4.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**12 235,4**	**10 800,7**	**9 083,2**	**8 117,1**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	16 737.2	17 601.0	17 338.7	16 865.5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8.0	8.5	8.3	8.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	10 076.0	10 939.8	10 677.5	10 204.4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.8	5.3	5.1	4.9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	843.0	1 175.0	633.0	1 080.7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.00 / 7.00 / 7.00	7.00 / 7.00 / 7.00	7.00 / 7.00 / 7.00	7.00 / 7.00 / 7.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	51.5	46.5	49.0	97.0
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
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$)	**Dic.01 2023**	**Dic.04 2023**	**Dic.05 2023**	**Dic.06 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-4.5	87.5	-30.1	-5.1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	40,1	24,2	36,7	-25,4
a. Mercado spot con el público	35,3	31,5	77,7	8,9
i. Compras	425,1	506,5	570,8	729,7
ii. (-) Ventas	389,8	475,0	493,1	720,8
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	151,1	9,0	149,3	-188,6
i. Pactadas	282,3	260,6	343,6	314,8
ii. (-) Vencidas	131,2	251,6	194,3	503,4
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	162,1	25,3	213,1	-169,7
i. Pactadas	403,8	446,0	551,7	759,2
ii. (-) Vencidas	241,8	420,7	338,6	929,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	616,8	454,0	897,2	577,5
ii. A futuro	69,0	34,0	75,0	92,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	111,9	166,7	111,1	427,1
i. Compras	230,3	416,5	304,2	927,0
ii. (-) Ventas	118,4	249,8	193,1	499,8
f. Efecto de Opciones	3,3	-0,6	-2,4	0,6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-33,5	75,3	-8,4	2,8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7355	3.7445	3.7560	3.7540
(*) Datos preliminares				

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera