BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	24 Oct 22	25 Oct 22	26 Oct 22	27 Oct 22	28 Oct 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**3 562.2**	**4 313.5**	**4 890.9**	**4 087.3**	**3 133.4**
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones de Reducción del BCR					
- Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	17 342.5	17 342.5	17 342.5	17 342.5	17 342.5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Noviembre del 2022	1 050.1	1 050.1	1 050.1	1 050.1	1 050.1
Vencimiento de CD BCRP del 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	300.0				300.0
Propuestas recibidas	750.0				900.0
Plazo de vencimiento	7 d				7 d
Tasas de interés: Mínima	7.51				7.72
Máxima	7.51				7.99
Promedio	7.51				7.82
Saldo	12 258.4	12 258.4	12 258.4	11 458.4	11 758.4
Próximo vencimiento de Reo de Valores el 7 de Noviembre del 2022	300.0	300.0	300.0	1 500.0	1 500.0
Vencimiento de Reo Valores del 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022	300.0	300.0	300.0	0.0	2 800.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Carteras de Créditos (General)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco de Cartera General					
Vencimiento de Reso de Cartera General del 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022					
ix. Subasta de Compra Temporal de Carteras de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	9 129.8	9 129.8	9 129.8	9 129.8	9 129.8
Próximo vencimiento de Reco de Carteras Alternativo el 26 de Diciembre del 2022	9.7	9.7	9.7	9.7	9.7
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativo del 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
v. Subasta de Compra Temporal de Carteras de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Bancos)					
Garantía para los créditos					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo adjudicado	43 799.9	43 799.9	43 799.9	43 799.9	43 799.9
vi. Subasta de Compra Temporal de Carteras 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	1 883.7	1 883.7	1 883.7	1 883.7	1 883.7
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 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022					
viii. Subasta de Compra Temporal de Carteras de Créditos para el Acceso de Liquidez					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3.0	3.0	3.0	3.0	3.0
Próximo vencimiento de Reco de Carteras para el Acceso de Liquidez del 17 de Noviembre del 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Carteras para el Acceso de Liquidez del 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022			0.0	0.0	0.0
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)		490.0	490.1	490.1	490.0
Propuestas recibidas	1262.0		1155.0	695.0	330.0
Plazo de vencimiento	92 d		91 d	92 d	91 d
Mínimo	0.00		0.00	0.00	0.00
Máximo	0.00		0.00	0.00	0.00
Promedio	0.00		0.00	0.00	0.00
Saldo	15 722.1	15 390.6	16 550.7	16 550.7	17 000.7
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 15 de Noviembre del 2022	1 121.4	1 570.0	1 570.0	1 570.0	1 570.0
Vencimiento de CDV BCRP del 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022	1 121.4	0.0	0.0	0.0	0.0
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 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 794.1	2 164.1	2 988.9	2 488.0	2 823.5
Propuestas recibidas	1 794.1	2 164.1	2 988.9	2 988.1	2 823.5
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de interés: Mínima	6.80	6.80	6.80	6.80	6.70
Máxima	7.00	7.00	7.00	7.00	7.00
Promedio	6.97	6.97	6.97	6.97	6.95
Saldo	2 004.0	2 400.0	2 399.9	2 400.0	2 823.5
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 14 de Octubre del 2022	1 794.1	2 400.0	2 399.9	2 400.0	2 823.5
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022	2 004.0	2 400.0	2 399.9	2 400.0	2 823.5
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)		300.0			300.0
Propuestas recibidas		600.0			600.0
Plazo de vencimiento		181 d			182 d
Tasas de interés: Mínima		7.74			7.77
Máxima		8.25			7.89
Promedio		7.85			7.83
Saldo	8 804.7	8 804.7	8 804.7	8 804.7	8 804.7
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 2 de Noviembre del 2022	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022	600.0	600.0	600.0	600.0	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 del 31 de octubre al 4 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 31 de octubre al 4 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 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Repoley)	600.0				
Propuestas recibidas	900.0				
Plazo de vencimiento	7 d				
Tasas de interés: Mínima	7.15				
Máxima	7.30				
Promedio	7.22				
Saldo	3 147.0	3 117.0	3 117.0	3 117.0	3 117.0
Próximo vencimiento de Reo Bancos el 14 de Octubre del 2022	30.0	625.0	625.0	625.0	625.0
Vencimiento de REPO del 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022	30.0	0.0	0.0	0.0	1 365.0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso					
Vencimiento de REPO del 31 de octubre al 4 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 Reco Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 31 de octubre al 4 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 Reco Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0 300.0 300.0 300.0	200.0 200.0 300.0	299.9 200.0 300.0 300.0	300.0 200.0 227.0	200.0 200.0
Propuestas recibidas	510.0 510.0 600.0	400.0 500.0 498.0	700.0 500.0 506.0	700.0 498.0 727.0	700.0 700.0
Plazo de vencimiento	92 d 182 d 92 d 92 d	92 d 182 d 92 d	92 d 182 d 92 d 92 d	92 d 92 d 92 d	91 d 94 d
Tasas de interés: Mínima	3.10 4.11 3.40 3.70	3.55 4.15 3.60	3.62 4.15 3.59 3.65	3.69 3.68 3.79	3.74 3.55
Máxima	3.65 4.13 3.55 3.80	3.77 4.16 3.80	3.80 4.36 3.81 3.79	3.75 3.71 4.00	3.99 3.65
Promedio	3.45 4.12 3.47 3.75	3.73 4.15 3.75	3.72 4.25 3.64 3.74	3.75 3.70 3.86	3.85 3.58
Saldo	10 618.1	10 438.1	10 857.0	10 856.7	10 704.7
Próximo vencimiento de SC-Venta el 31 de Octubre del 2022	600.0	786.0	685.0	200.0	300.0
Vencimiento de SC - Venta del 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022	2 451.0	1 651.0	865.0	200.0	700.0
xxi. Subasta de Reso de Valores para ramper Alzas (SBT)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REO					
Vencimiento de REO del 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022					
xxii. Subasta de Swap de Tasa de Interés	30.0	30.0			30.0
Propuestas recibidas	110.0	100.0			106.0
Plazo de vencimiento	92 d	182 d			273 d
Tasas de interés: Mínima	7.55	6.98			6.90
Máxima	7.00	7.01			6.90
Promedio	7.00	7.00			6.90
Saldo	3 100.1	3 090.1	3 190.1	3 190.1	3 170.1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 1 de Noviembre del 2022	50.0	100.0	50.0	50.0	50.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 31 de octubre al 4 de noviembre de 2022	300.0	150.0	50.0	50.0	150.0
b. Fondo Para Fortalecimiento de la Solvencia Patrimonial (FOLAVEM) - Fondo (0) (FOLAVEM) - Fondo (0) (FOLAVEM)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Forwards (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
ii. Ventas (millones de US$)	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$)	n.a	n.a	-19.7	-347.7	-148.5
i. Compras (millones de US$)	0.4	0.0	25.3	1.0	1.1
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	45.0	348.7	149.4
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Ventas de CD BCRP y BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3 377.2**	**2 764.4**	**2 468.9**	**2 332.7**	**1 969.4**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0213%	0.0213%	0.0214%	0.0189%	0.0199%
b. Compra temporal diaria de valores (Repo de subasta)	n.o	n.o	n.o	n.o	n.o
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	738.0	759.0	508.7	703.8	582.0
Tasa de interés	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**4 115.2**	**3 523.5**	**2 977.6**	**3 035.5**	**2 551.4**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12 845.8	12 845.5	12 845.5	12 831.1	12 831.0
b. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del EOM) (*)	6.4	6.3	6.4	6.4	6.3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado millones de S/.	6 145.2	6 045.9	5 865.4	5 735.6	5 563.0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del RMEL)	3.1	3.0	2.9	2.8	2.8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 176.1	856.5	761.1	847.6	777.5
Tasas de interés Mínima / TIBO	7.00 / 7.30 / 7.01	7.00 / 7.00 / 7.00	7.00 / 7.00 / 7.00	7.00 / 7.00 / 7.00	7.00 / 7.00 / 7.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	41.0	-	9.0	-	-
Tasas de interés Mínima / Máximo/ Promedio	3.75 / 3.75 / 3.75	-/-/-	3.75 / 3.75 / 3.75	-/-/-	-/-/-
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.21 2022**	**Oct.24 2022**	**Oct.25 2022**	**Oct.26 2022**	**Oct.27 2022**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e.i + f + g	43.7	54.6	-18.7	-19.4	-46.2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	110.1	-52.3	-30.5	-96.2	-139.0
a. Mercado spot con el público	122.5	-29.5	-12.5	-67.6	-77.2
i. Compras	527.4	441.5	297.0	370.1	381.5
ii. (-) Ventas	404.9	471.1	309.5	457.6	458.7
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-112.9	-34.4	6.4	110.6	245.8
i. Pactadas	68.5	133.3	283.1	211.4	501.4
ii. (-) Vencidas	181.4	167.7	276.7	100.8	255.6
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-20.9	-28.1	-34.0	110.0	191.3
i. Pactadas	338.9	362.8	413.9	386.1	828.3
ii. (-) Vencidas	359.8	390.9	447.9	256.0	637.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	399.9	391.1	289.0	319.8	312.4
ii. A futuro	28.0	316.0	118.0	83.0	20.0
e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	186.5	217.6	189.8	169.1	367.1
i. Compras	357.7	391.5	446.1	251.5	620.7
ii. (-) Ventas	171.3	163.8	276.3	82.4	253.6
f. Efecto de Cociones	-1.7	-6.3	1.7	1.1	9.8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	6.9	104.3	-47.0	52.7	-16.1
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.9935	4.0020	3.9968	3.9897	3.9779
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera