BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	31 Oct 22	02 Nov 22	03 Nov 22	04 Nov 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**3 225,1**	**2 862,2**	**1 935,8**	**1 239,5**
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	12 354,5	12 354,5	12 354,5	12 354,5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Noviembre del 2022	1 050,1	1 050,1	1 050,1	1 050,1
Vencimiento de CD BCRP del 7 al 11 de noviembre de 2022	n.o.	n.o.	n.o.	n.o.
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	300,0	4000,0 500,0 4600,0	5000,0 700,0 3220,0	
Propuestas recibidas	530,0	7900,0 1620,0 4820,0	7020,0 1670,0 3220,0	7220,0 3070,0 900,0 1100,0 3595,0
Plazo de vencimiento	7 d	14 d 14 d 14 d	14 d 14 d 14 d	14 d 14 d 14 d 14 d
Tasas de interés: Mínima	7,02	7,03 7,36 7,0	7,02 7,46 7,02	7,04 7,07 7,72 7,08 7,03
Máxima	7,10	7,15 7,46 7,08	7,08 7,52 7,08	7,09 7,13 7,85 7,11 7,10
Promedio	7,02	7,08 7,40 7,04	7,05 7,48 7,05	7,07 7,08 7,78 7,09 7,05
Saldo	12 658,4	20 858,4	19 678,4	18 858,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 7 de Noviembre del 2022	900,0	11 400,0	9 520,0	9 200,0
Vencimiento de Repo Valores del 7 al 11 de noviembre de 2022	3 100,0	11 400,0	9 520,0	9 200,0
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 7 al 11 de noviembre de 2022				
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	6 578,6	6 578,6	6 578,6	6 578,6
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 26 de Diciembre del 2022	9,7	9,7	9,7	9,7
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 7 al 11 de noviembre de 2022	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Bancos)				
Garantía para los créditos				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo adicionado	43 399,9	43 399,9	43 399,9	43 399,9
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 adicionado	1 883,3	1 883,3	1 883,3	1 883,3
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 7 al 11 de noviembre de 2022				
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera 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
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez el 17 de Noviembre del 2022	n.o.	n.o.	n.o.	n.o.
Vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez del 7 al 11 de noviembre de 2022	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Margen: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	17 000,7	17 000,7	17 000,7	17 000,7
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 15 de Noviembre del 2022	1 570,0	1 570,0	1 570,0	1 570,0
Vencimiento de CDV BCRP del 7 al 11 de noviembre de 2022	n.o.	n.o.	n.o.	n.o.
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 7 al 11 de noviembre de 2022				
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 7 al 11 de noviembre de 2022				
xii. Subasta de Depósitos a Plazo en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)		300,0		300,0
Propuestas recibidas		798,0		400,0
Plazo de vencimiento		181 d		181 d
Tasas de interés: Mínima		7,85		7,87
Máxima		7,90		8,00
Promedio		7,87		7,90
Saldo	6 874,7	6 874,7	6 874,7	6 874,7
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 7 de Noviembre del 2022	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 7 al 11 de noviembre de 2022	600,0	300,0	300,0	800,0
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 7 al 11 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 CDR BCRP del 7 al 11 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				
Vencimiento de CD BCRP del 7 al 11 de noviembre de 2022				
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)			500,0	500,0
Propuestas recibidas			1500,0	671,0
Plazo de vencimiento			7 d	7 d
Tasas de interés: Mínima			7,75	7,76
Máxima			7,87	8,01
Promedio			7,80	7,91
Saldo	2 492,0	2 452,0	2 252,0	2 752,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 7 de Noviembre del 2022	40,0	700,0	340,0	340,0
Vencimiento de REPO del 7 al 11 de noviembre de 2022	740,0	700,0	0,0	1 140,0
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 7 al 11 de noviembre de 2022				
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Especial)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo Excepcion				
Vencimiento de REPO Excepción del 7 al 11 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 Repo Sustitución				
Vencimiento de REPO Sustitución del 7 al 11 de noviembre de 2022				
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300,0		200,0 300,0 180,0	
Propuestas recibidas	877,0		796,0 970,0 796,0	
Plazo de vencimiento	93 d		93 d 93 d 93 d	
Tasas de interés: Mínima	3,85		3,85 3,60 3,50	
Máxima	3,96		4,00 3,61 4,00	
Promedio	3,77		3,96 3,61 3,86	
Saldo	16 054,0	16 054,0	16 574,0	16 574,0
Próximo vencimiento de SC_Venta el 7 de Noviembre del 2022	200,0	200,0	200,0	400,0
Vencimiento de SC - Venta del 7 al 11 de noviembre de 2022	400,0	400,0	200,0	770,0
xxi. Subasta de Repo de Valores para renovar deudores (BBTA)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de RED				
Vencimiento de BBTA del 7 al 11 de noviembre de 2022				
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés	30,0			30,0
Propuestas recibidas	50,0			119,0
Plazo de vencimiento	92 d			273 d
Tasas de interés: Mínima	7,01			6,00
Máxima	7,01			6,95
Promedio	7,01			6,95
Saldo	3 090,1	3 140,1	3 190,1	3 080,1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 8 de Noviembre del 2022	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 7 al 11 de noviembre de 2022	140,0	100,0	50,0	124,0
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	n.o.	n.o.	n.o.	n.o.
i. Compras (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
ii. Ventas (millones de US$)	n.o.	n.o.	n.o.	n.o.
Tipo de cambio promedio	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000
d. Operaciones con el Sector Público (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US$)	n.o.	14,4	6,3	n.o.
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	-197,4	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP				
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP (Vencimiento)		4,0		16,3
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3 525,1**	**12 262,2**	**11 339,8**	**10 773,3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Corretaje (tasa efectiva diaria)	0,0207%	0,0189%	0,0189%	0,0190%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional Tasa de interés	1 489,6	0,0	0,0	0,0
d. Depósitos Overnight en moneda nacional Tasa de interés	4,00%	4,00%	4,00%	4,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2 035,5**	**12 262,2**	**11 339,8**	**10 773,3**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 200,0	12 138,2	16 052,0	16 436,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	n.o.	n.o.	n.o.	n.o.
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 090,5	5 027,7	8 860,0	9 244,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,3	2,3	4,4	4,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones al contado en moneda nacional	1 628,7	642,7	812,2	1 035,7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,50 / 7,00 / 7,00	7,00 / 7,00 / 7,00	7,00 / 7,00 / 7,00	7,00 / 10 / 7,06
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)		15,0	98,8	39,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	- / - / -	3,25 / 3,25 / 3,25	3,95 / 4,00 / 4,00	4,00 / 4,00 / 4,00
c. Total reservas secundarias en 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$)	**Oct.28 2022**	**Oct.31 2022**	**Nov.02 2022**	**Nov.03 2022**
Flujo de la posición global = a + b.1 - c.i + e + f + g	-126,4	131,2	1,1	30,1
Flujo de la posición contable = a + b.1 - c.ii + e + g	-137,7	25,0	-61,9	-107,8
a. Mercado spot con el público	-49,9	13,5	-67,7	-92,1
i. Compras	490,8	639,6	455,7	452,2
ii. (-) Ventas	540,7	626,0	523,4	544,3
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	93,8	190,6	-42,0	-202,4
i. Pactadas	125,0	337,4	146,8	114,0
ii. (-) Vencidas	31,3	296,7	188,8	316,3
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	135,5	-9,1	-98,6	-218,9
i. Pactadas	462,9	313,9	226,4	387,4
ii. (-) Vencidas	327,4	323,0	325,0	606,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	354,9	416,2	288,2	409,0
ii. A futuro	124,0	116,0	80,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	218,2	99,2	144,9	285,8
i. Compras	238,0	321,4	356,1	598,9
ii. (-) Ventas	19,9	222,2	163,2	313,1
f. Efecto de Opciones	4,3	-1,8	6,4	1,6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	38,9	-3,4	-3,0	108,2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Databis)	3,9784	3,9899	3,9751	3,9717

(*) Data preliminar

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera