BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	07 Nov 22	08 Nov 22	09 Nov 22	10 Nov 22	11 Nov 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**2 821,1**	**3 639,3**	**3 260,6**	**3 323,8**	**1 861,3**
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)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	12 254.5	12 254.5	12 254.5	12 254.5	12 254.5
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 14 al 18 de noviembre de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	1 760.1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	4000.0 3800.0	3000.1 4500.0	3000.0 4000.0	4000.0 3200.0	2000.0 1200.0 300.0
Propuestas recibidas	7120.0 4590.0	6070.0 6250.0	8471.0 6570.0	6471.0 3200.0	3970.0 880.0 1425.0
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 94 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	7.06 7.06	7.07 7.07	7.12 7.15	7.13 7.0	7.31 7.97 7.37
Máxima	7.12 7.10	7.11 7.11	7.14 7.21	7.50 7.21	7.36 8.08 7.55
Promedio	7.09 7.09	7.09 7.10	7.13 7.16	7.16 7.15	7.32 8.02 7.45
Saldo	18 758.4	18 458.5	17 958.4	17 658.4	13 158.4
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 14 de Noviembre del 2022	7 800.0	7 500.1	7 500.0	8 000.0	3 500.0
Vencimiento de Reco Valores del 14 al 18 de noviembre de 2022	9 100.0	8 800.1	8 300.0	8 000.0	3 800.0
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 14 al 18 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	6 378.6	6 378.6	6 378.6	6 378.6	6 378.6
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 26 de Diciembre del 2022	9.7	9.7	9.7	9.7	9.7
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 14 al 18 de noviembre de 2022	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 Reco Especial - CDR del 14 al 18 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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez el 17 de Noviembre del 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez del 14 al 18 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					
Máximo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	17 000.7	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	1 570.0
Vencimientos de CDV BCRP del 14 al 18 de noviembre de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	2 824.6
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 14 al 18 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 14 al 18 de noviembre de 2022					
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0		300.0	195.5	
Propuestas recibidas	615.6		812.2	410.5	
Plazo de vencimiento	182 d		181 d	181 d	
Tasas de interés: Mínima	7.81		7.98	7.41	
Máxima	7.92		8.00	7.98	
Promedio	7.86		7.98	7.78	
Saldo	6 804.7	6 804.7	6 604.7	6 800.2	6 800.2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 14 de Noviembre del 2022	500.0	500.0	304.7	304.7	304.7
Vencimiento de Coloc-TP del 14 al 18 de noviembre de 2022	500.0	500.0	0.0	0.0	904.7
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 14 al 18 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 14 al 18 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 14 al 18 de noviembre de 2022					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	300.0				
Propuestas recibidas	858.5				
Plazo de vencimiento	30 d				
Tasas de interés: Mínima	7.70				
Máxima	8.06				
Promedio	7.77				
Saldo	2 712.0	2 712.0	2 712.0	2 412.0	1 912.0
Próximo vencimiento de Reco Regular el 21 de Noviembre del 2022	300.0	300.0	300.0	500.0	300.0
Vencimiento de REPO del 14 al 18 de noviembre de 2022	800.0	800.0	800.0	500.0	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 Reso					
Vencimiento de REPO del 14 al 18 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 Reso Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 14 al 18 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 Reso Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 14 al 18 de noviembre de 2022					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0	200.0			
Propuestas recibidas	415.0	330.0			
Plazo de vencimiento	92 d	92 d			
Tasas de interés: Mínima	3.79	3.95			
Máxima	3.89	4.00			
Promedio	3.84	3.98			
Saldo	39 174.0	39 059.0	39 094.0	39 004.0	39 004.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 14 de Noviembre del 2022	315.0	55.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de SC - Venta del 14 al 18 de noviembre de 2022	370.0	55.0	0.0	0.0	750.0
xxi. Subasta de Reco de Valores para proveer dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0				
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 14 al 18 de noviembre de 2022					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés	30.0	Desierta			Desierta
Propuestas recibidas	90.0	90.0			45.0
Plazo de vencimiento	60 d	181 d			224 d
Tasas de interés: Mínima	7.01				
Máxima	7.01				
Promedio	7.01				
Saldo	3 110.1	3 060.1	3 060.1	3 010.1	2 985.1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 15 de Noviembre del 2022	50.0	50.0	50.0	25.0	50.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 14 al 18 de noviembre de 2022	125.0	75.0	75.0	25.0	150.0
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.a	n.a	n.a	n.a	n.a
i. Compras (millones de US$)	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a
Tipo de cambio promedio	n.nnnn	n.nnnn	n.nnnn	n.nnnn	n.nnnn
ii. Ventas (millones de US$)	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$)	0.1	2.8	0.5	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.1	2.9	0.5	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRPME y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	126.6	0.0	71.9	0.0	113.4
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**11 131,1**	**11 139,4**	**10 586,6**	**10 898,0**	**8 361,3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0190%	0.0192%	0.0192%	0.0195%	0.0204%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por reculación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0.0	300.0	0.0	450.0	984.8
Tasa de interés	5.00%	5.00%	5.00%	5.00%	5.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**11 131,1**	**10 839,4**	**10 586,6**	**10 248,0**	**4 376,4**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	17 012.2	17 220.8	17 276.7	17 280.3	17 271.5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado 7% del TOSE) (*)	8.5	8.6	8.7	8.7	8.7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	9 820.3	10 028.8	10 086.5	10 094.0	10 085.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado 7% del TOSE) (*)	4.9	5.0	5.1	5.1	5.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 263.0	1 630.2	1 573.1	1 232.7	1 274.6
Tasas de interés Mínima / Máxima / TIBO	7.00 / 7.00 / 7.00	7.00 / 7.00 / 7.00	7.00 / 7.00 / 7.00	7.00 / 7.10 / 7.00	7.25 / 7.25 / 7.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	29.8	-	-	42.0	10.0
Tasas de interés Mínima / Máxima/ Promedio	4.00 / 4.00 / 4.00	- / - / -	- / - / -	4.00 / 4.00 / 4.00	4.00 / 4.00 / 4.00
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRPME y BTP					
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.04 2022**	**Nov.07 2022**	**Nov.08 2022**	**Nov.09 2022**	**Nov.10 2022**
Flujo de la posición diaria: = a + b.i - c.i + e + f + g	-103.4	-56.5	47.0	-46.5	-23.4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-110.4	-73.3	-8.3	-155.7	75.5
a. Mercado spot con el público	-92.7	-85.9	-37.5	-121.9	60.5
i. Compras	537.6	339.8	655.3	549.1	870.3
ii. (-) Ventas	630.3	425.7	692.8	671.0	809.8
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	135.7	133.8	77.7	-128.7	161.3
i. Pactadas	322.3	361.3	236.1	397.8	302.3
ii. (-) Vencidas	186.7	227.6	158.4	526.5	141.0
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	79.9	64.9	-0.2	-249.8	267.5
i. Pactadas	333.7	497.4	430.3	450.9	439.6
ii. (-) Vencidas	253.8	432.5	430.4	700.7	172.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	332.3	341.0	321.0	471.3	477.3
ii. A futuro	10.0	0.0	140.0	25.0	144.0
e. Operaciones swof asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	59.8	223.4	311.6	144.1	49.9
i. Compras	237.8	429.6	429.2	651.5	165.5
ii. (-) Ventas	177.9	206.3	117.5	507.3	115.6
f. Efecto de Opciones	4.2	0.9	7.6	2.2	7.3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-63.3	-58.8	-39.6	-17.9	-3.9
h. Crédito por reculación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.9571	3.9513	3.9256	3.9133	3.8634

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera