BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	04 Set 23	05 Set 23	06 Set 23	07 Set 23	08 Set 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**7 380,0**	**7 345,2**	**7 610,2**	**7 219,4**	**6 475,4**
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)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	23 296.7	23 296.7	23 296.7	23 296.7	23 296.7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Setiembre del 2023	500.0	500.0	500.0	500.0	1 680.7
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 15 de setiembre de 2023	500.0	500.0	500.0	500.0	4 980.6
ii. Subasta de Correos Temporal de Valores (REPO)	2000.0 500.0 1800.0	1500.0 500.0 1500.0	1000.0 500.0 1500.0	1000.1 500.0 1400.0	1000.0 490.0 500.0 1000.0
Procesadas recibidas	3450.0 2038.0 3975.0	3800.0 1650.0 3000.0	3700.0 1000.0 2560.0	2830.0 1530.0 1900.0	2150.0 740.0 1200.0 1600.0
Plazo de vencimiento	1 d 29 d 1 d	1 d 29 d 1 d	1 d 29 d 1 d	1 d 29 d 1 d	3 d 90 d 31 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	7.79 7.89 7.80	7.80 7.90 7.81	7.82 7.95 7.84	7.86 7.96 7.90	7.92 7.70 7.98 7.93
Máxima	7.82 7.90 7.82	7.83 7.90 7.83	7.84 7.95 7.88	7.87 7.96 7.90	7.92 7.83 7.98 7.93
Promedio	7.80 7.89 7.81	7.81 7.90 7.82	7.82 7.95 7.85	7.87 7.96 7.90	7.92 7.75 7.98 7.93
Saldo	18 903.4	17 853.4	17 353.4	16 553.5	16 143.4
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 11 de Setiembre del 2023	4 550.0	3 600.0	3 700.0	3 400.1	2 000.0
Vencimiento de Reco Valores del 11 al 15 de setiembre de 2023	7 250.0	5 700.0	4 700.0	3 400.1	2 601.2
iii. Subasta de Correos Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco de Cartera General					
Vencimiento de Reco de Cartera General del 11 al 15 de setiembre de 2023					
iv. Subasta de Correos Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 301.7	6 301.7	6 301.7	6 300.8	6 300.8
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 3 de Octubre del 2023	0.9	0.9	0.9	2.7	2.7
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 11 al 15 de setiembre de 2023	0.9	0.9	0.9	0.0	0.0
v. Subasta de Correos Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Recular)					
Garantía para los créditos					
Procesadas 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 Correos Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Esecial)					
Garantía para los créditos					
Procesadas 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 Correos Temporal de Valores (REPO Esecial - CDR)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Esecial - CDR					
Vencimiento de Reco Esecial - CDR del 11 al 15 de setiembre de 2023					
viii. Subasta de Correos Temporal de Cartera de Créditos para el Apoyo de Liquidez					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco de Cartera para el Apoyo de Liquidez					
Vencimientos de Reco de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 11 al 15 de setiembre de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 11 al 15 de setiembre 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 setiembre de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)					
Procesadas 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 setiembre de 2023					
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0	200.0		58.9	
Procesadas recibidas	421.3	262.2		136.1	
Plazo de vencimiento	183 d	183 d		182 d	
Tasas de interés: Mínima	7.61	7.63		7.48	
Máxima	7.67	7.67		7.56	
Promedio	7.66	7.64		7.48	
Saldo	6 744.4	6 944.4	6 944.4	6 769.4	6 769.4
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 10 de Octubre del 2023	233.9	233.9	233.9	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 11 al 15 de setiembre de 2023	233.9	233.9	233.9	0.0	0.0
xiii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Procesadas 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 setiembre de 2023					
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	280.0	280.0	280.0	280.0	280.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 3 de Noviembre del 2023	130.0	130.0	130.0	130.0	130.0
Vencimiento de CDR BCRP del 11 al 15 de setiembre 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)					
Procesadas 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 setiembre de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Recular)	160.0				
Procesadas recibidas	290.0				
Plazo de vencimiento	29 d				
Tasas de interés: Mínima	7.90				
Máxima	7.99				
Promedio	7.94				
Saldo	1 557.0	1 057.0	757.0	757.0	757.0
Próximo vencimiento de Reco Recular el 27 de Setiembre del 2023	500.0	300.0	25.0	25.0	25.0
Vencimiento de REPO del 11 al 15 de setiembre de 2023	800.0	300.0	0.0	0.0	0.0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco					
Vencimiento de REPO del 11 al 15 de setiembre 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 Reco Excansion					
Vencimiento de REPO Excansión del 11 al 15 de setiembre de 2023					
xix. Correos con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 11 al 15 de setiembre de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		200.0 200.0	200.0 200.0 300.0	198.0 200.0	200.0
Procesadas recibidas		650.0 630.0	670.0 775.0 575.0	398.0 214.0	385.0
Plazo de vencimiento		91 d 366 d	91 d 366 d 91 d	91 d 365 d	367 d
Tasas de interés: Mínima		4.96 4.97	4.96 4.96 4.99	4.96 4.95	4.44
Máxima		4.99 4.97	4.99 4.49 4.49	4.96 4.95	4.44
Promedio		4.99 4.97	4.99 4.49 4.94	4.96 4.95 4.97	4.44
Saldo	94 721.9	94 621.7	94 677.9	95 055.9	95 355.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 22 de Setiembre del 2023	600.0	564.0	260.0	200.0	200.0
Vencimiento de SC - Venta del 11 al 15 de setiembre de 2023	1 164.0	564.0	0.0	0.0	0.0
xxi. Subasta de Reco de Valores para onower dólares (RED)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 11 al 15 de setiembre de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 16 de Setiembre del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 11 al 15 de setiembre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Usual. Reros 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	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	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$)	35.9	0.2	10.9	5.0	0.4
i. Compras (millones de US$)	35.9	0.2	10.9	5.0	0.4
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP. CD BCRP-NR y BTP	76.0	0.0	75.5	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	76.0	0.0	75.5	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**12 016.0**	**11 945.2**	**10 610.2**	**10 197.3**	**9 465.4**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	n.corresp.	n.corresp.	n.corresp.	n.corresp.	n.corresp.
(Cantidad (tipo efectivo diario)	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
b. Compra temporal diaria de valores (tipo de subasta)					
Tasa de interés					
c. Crédito por reducción monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	57.0	53.0	103.0	120.0	225.0
Tasa de interés	6.25%	6.25%	7.25%	6.25%	7.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**11 958.0**	**10 992.2**	**10 507.2**	**10 047.3**	**9 240.4**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	20 488.3	19 840.9	19 357.1	19 011.0	18 698.1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9.9	9.6	9.4	9.2	9.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	13 576.5	12 929.1	12 446.3	12 099.2	11 785.3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.6	6.3	6.0	5.9	5.7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 067.0	470.0	685.0	484.0	710.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75	7.75 / 7.75 / 7.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	75.0	70.0	80.0	65.0	61.0
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	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$)	**Set.01 2023**	**Set.04 2023**	**Set.05 2023**	**Set.06 2023**	**Set.07 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-50,2	25,1	-1,9	-96,6	40,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-24,8	12,8	-47,8	-116,6	82,3
a. Mercado spot con el público	-15,5	24,3	-41,2	-83,2	99,9
i. Compras	741,3	211,4	832,0	284,7	626,2
ii. (-) Ventas	756,9	187,2	873,2	367,8	526,3
b. Compras forward y swap al público (con v sin entrega)	173,5	21,4	75,6	68,7	-260,2
i. Pactadas	217,7	25,0	271,8	209,1	134,7
ii. (-) Vencidas	44,2	3,5	196,2	142,4	424,9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	205,1	9,3	-24,4	90,4	-142,5
i. Pactadas	397,3	33,0	305,6	324,3	749,0
ii. (-) Vencidas	192,2	23,6	330,0	233,8	891,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	321,9	58,9	451,6	432,9	623,3
ii. A futuro	125,0	0,0	19,0	83,0	100,6
e. Operaciones spot asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entregas	140,0	20,9	136,8	63,0	457,1
i. Compras	182,8	23,5	321,8	204,5	881,9
ii. (-) Ventas	42,8	2,6	185,0	141,5	424,8
f. Efecto de Opciones	0,2	0,2	-3,9	-2,5	-0,9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	4,7	-12,3	-59,8	39,2	98,9
h. Crédito por reducción monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6912	3.6913	3.7068	3.7055	3.7139
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera