BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	25 Set 23		26 Set 23		27 Set 23		28 Set 23		29 Set 23		
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**7 584,0**		**6 510,4**		**6 663,0**		**6 292,0**		**4 690,2**		
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)	300.0	100.0	197.0	100.0	300.0		300.0		200.0		
Procesuales recibidas	559.0	280.0	197.0	300.0	664.0		490.0		617.0		
Plazo de vencimiento	178 d	360 d	182 d	366 d	181 d		180 d		180 d		
Tasas de interés: Mínima	7.01	6.32	7.01	6.32	7.01		7.02		6.95		
Máxima	7.02	6.33	7.03	6.33	7.03		7.03		7.02		
Promedio	7.02	6.33	7.01	6.32	7.02		7.02		7.01		
Saldo	31 857.6		32 466.6		32 916.6		33 366.6		33 636.6		
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de Octubre del 2023	1 985.1		1 985.1		1 985.1		1 985.1		1 985.1		
Vencimiento de CD BCRP del 2 al 6 de octubre de 2023	0.0		0.0		0.0		0.0		1 985.1		
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)									600.0		
Procesuales recibidas									910.0		
Plazo de vencimiento									91 d		
Tasas de interés: Mínima									7.48		
Máxima									7.55		
Promedio									7.53		
Saldo	13 492.2		13 492.2		13 492.2		13 492.2		13 492.2		
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 2 de Octubre del 2023	600.0		600.0		600.0		600.0		300.0		
Vencimiento de Reco Valores del 2 al 6 de octubre de 2023	600.0		600.0						2 900.0		
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)											
Procesuales 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 2 al 6 de octubre de 2023											
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)											
Procesuales recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo	6 300.8		6 300.8		6 300.8		6 300.8		6 300.8		
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 3 de Octubre del 2023	2.7		2.7		2.7		2.7		2.7		
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 2 al 6 de octubre de 2023	0.0		0.0		0.0		0.0		2.7		
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)											
Garantía para los créditos											
Procesuales 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											
Procesuales 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)											
Procesuales recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR											
Vencimiento de Reco Especial - CDR del 2 al 6 de octubre de 2023											
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acceso de Liquidez											
Procesuales recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez											
Vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez del 2 al 6 de octubre de 2023											
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Ventables del BCR (CDV BCRP)											
Procesuales recibidas											
Plazo de vencimiento											
Mínimo: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de CDV BCRP											
Vencimientos de CDV BCRP del 2 al 6 de octubre de 2023											
x. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)											
Procesuales recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de CDLD BCRP											
Vencimiento de CDLD BCRP del 2 al 6 de octubre de 2023											
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 445.9	1 621.5	3 000.0	1 649.0	2 000.1	2 672.8	2 999.9	2 108.0	1 999.9	1 825.3	
Procesuales recibidas	3 445.9	1 621.5	3 083.0	1 659.0	3 831.0	2 672.8	3 434.5	2 108.0	2 378.5	1 825.3	
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d	3 d	
Tasas de interés: Mínima	7.10	7.15	7.10	7.25	7.00	7.25	7.15	7.20	7.15	7.20	
Máxima	7.50	7.50	7.50	7.50	7.50	7.50	7.50	7.50	7.50	7.50	
Promedio	7.44	7.37	7.45	7.50	7.45	7.44	7.46	7.45	7.45	7.45	
Saldo	5 067.4		4 649.0		4 672.9		5 107.9		3 825.2		
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 2 de Octubre del 2023	5 067.4		4 649.0		4 672.9		5 107.9		3 825.2		
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 2 al 6 de octubre de 2023	5 067.4		4 649.0		4 672.9		5 107.9		3 825.2		
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)											
Procesuales recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo	6 769.4		6 769.4		6 769.4		6 769.4		6 769.4		
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 10 de Octubre del 2023	300.0		300.0		300.0		300.0		300.0		
Vencimiento de Coloc-TP del 2 al 6 de octubre de 2023	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0		
xiii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación											
Procesuales recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de Coloc-BN											
Vencimiento de Coloc - BN del 2 al 6 de octubre de 2023											
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	300.0		200.0		198.0				300.0		
Procesuales recibidas	600.0		570.0		198.0				910.0		
Plazo de vencimiento	90 d		90 d		91 d				91 d		
Tasas de interés: Mínima	5.33		5.45		5.53				5.65		
Máxima	5.33		5.50		5.60				5.69		
Promedio	5.33		5.50		5.64				5.67		
Saldo	1 010.0		1 208.0		1 508.0		1 508.0		1 808.0		
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 2 al 6 de octubre de 2023	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0		
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Reconociación Reajustada (CDBCRP-NR)											
Procesuales recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR											
Vencimientos de CD BCRP del 2 al 6 de octubre de 2023											
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)											
Procesuales recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo	757.0		757.0		732.0		732.0		732.0		
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de Octubre del 2023	25.0		25.0		200.0		200.0		200.0		
Vencimiento de REPO del 2 al 6 de octubre de 2023	25.0		25.0		0.0		0.0		360.0		
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa											
Procesuales recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de Reco											
Vencimiento de REPO del 2 al 6 de octubre de 2023											
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)											
Procesuales recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de Reco Expansión											
Vencimiento de REPO Expansión del 2 al 6 de octubre de 2023											
xix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)											
Procesuales recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de Reco Sustitución											
Vencimiento de REPO Sustitución del 2 al 6 de octubre de 2023											
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0			200.0	300.0	135.0
Procesuales recibidas	1074.0	730.0	1008.0	487.0	1210.0	1014.0			726.0	825.0	185.0
Plazo de vencimiento	366 d	366 d	182 d	366 d	366 d	366 d			367 d	367 d	367 d
Tasas de interés: Mínima	5.37	5.29	5.24	5.48	5.22	5.27			5.45	5.57	5.72
Máxima	5.49	5.64	5.46	5.75	5.55	5.47			5.54	5.54	5.80
Promedio	5.40	5.39	5.39	5.63	5.41	5.34			5.52	5.47	5.77
Saldo	37 455.2		38 055.2		38 655.2		38 655.2			39 090.2	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 17 de Octubre del 2023	200.0		200.0		200.0		200.0			190.0	
Vencimiento de SC - Venta del 2 al 6 de octubre de 2023	200.0		200.0		200.0		200.0			0.0	
xxi. Subasta de Reco de Valores para proveer dólares (RED)											
Procesuales recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de RED											
Vencimiento de RED del 2 al 6 de octubre de 2023											
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés											
Procesuales 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 2 al 6 de octubre 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	n.a.		n.a.		n.a.		n.a.		n.a.		
i. Compras (millones de US$)	n.a.		n.a.		n.a.		n.a.		n.a.		
Tipo de cambio promedio	n.a.		n.a.		n.a.		n.a.		n.a.		
ii. Ventas (millones de US$)	0.0		0.0		0.0		0.0		13.0		
Tipo de cambio promedio	0.0		0.0		0.0		0.0		3.8		
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	2.5		1.0		1.7		30.1		-17.7		
i. Compras (millones de US$)	2.0		1.0		1.7		30.1		0.3		
ii. Ventas (millones de US$)	n.a.		n.a.		n.a.		n.a.		18.0		
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	72.2		0.0		72.0		0.0		0.0		
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	72.2		0.0		72.0		0.0		0.0		
ii. Compras de BTP (Vencimiento)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 886,0**		**2 798,5**		**2 487,7**		**2 168,8**		**2 680,9**		
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones											
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).											
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0221%		0.0221%		0.0214%		0.0214%		0.0214%		
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0		
Tasa de interés											
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional											
Tasa de interés											
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	947.0		952.0		1 272.3		484.6		747.1		
Tasa de interés	5.25%		5.25%		5.25%		5.25%		5.25%		
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 933,0**		**1 846,5**		**1 196,4**		**1 621,2**		**1 913,4**		
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13 462.3		13 244.0		13 074.5		12 873.8		12 738.7		
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	6.5		6.4		6.3		6.2		6.2		
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 493.8		6 335.6		6 166.1		5 965.3		5 830.2		
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	3.1		3.1		3.0		2.9		2.8		
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP											
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	305.0		597.0		792.7		1 031.2		863.0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.50 / 7.50 / 7.50		7.50 / 7.50 / 7.50		7.50 / 7.50 / 7.50		7.50 / 7.50 / 7.50		7.50 / 7.50 / 7.50		
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	85.0		31.0		18.0		75.0		116.0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	6.40 / 6.40 / 6.40		6.40 / 6.40 / 6.40		6.40 / 6.40 / 6.40		6.40 / 6.40 / 6.40		6.40 / 6.40 / 6.40		
c. Total mercado secundario de CTDs*BR, CTDs*BR,MN y CTDs											
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 22 2023**		**Set 25 2023**		**Set 26 2023**		**Set 27 2023**		**Set 28 2023**		
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + o	27.7		-8.0		24.7		-56.3		31.4		
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + o	-51.0		-99.7		6.2		1.9		37.8		
a. Mercado spot con el público	-162.0		-74.4		-12.5		-65.5		39.5		
i. Compras	492.6		609.1		604.5		336.1		896.7		
ii. (-) Ventas	654.6		683.6		617.0		401.6		857.2		
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	167.4		218.4		73.3		-246.7		70.6		
i. Pactadas	276.5		326.0		275.5		521.6		188.6		
ii. (-) Vencidas	109.1		107.6		202.2		768.3		117.9		
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	193.9		279.1		209.0		-30.2		137.1		
i. Pactadas	836.9		414.6		577.9		547.6		421.7		
ii. (-) Vencidas	643.0		135.5		368.9		577.9		284.6		
d. Operaciones cambiarias interbancarias											
i. Al contado	750.1		539.7		453.9		448.5		656.9		
ii. A futuro	68.0		60.0		61.0		32.0		5.0		
e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entregas	508.7		-37.7		154.4		-202.9		170.9		
i. Compras	581.6		68.1		356.2		562.3		276.3		
ii. (-) Ventas	75.0		105.8		201.8		765.2		105.3		
f. Efecto de Opciones	-1.7		-6.5		-4.4		0.2		-2.7		
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	245.2		199.2		189.5		237.9		-6.1		
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera											
Tasa de interés											
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7505		3.7729		3.7850		3.7980		3.8049		

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera