BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	02 Oct 23	03 Oct 23	04 Oct 23	05 Oct 23	06 Oct 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**5 664,7**	**7 519,1**	**7 460,3**	**7 340,9**	**5 877,5**
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)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	33 636.6	31 651.5	31 651.5	31 651.5	31 651.5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de Octubre del 2023	1 985.1	1 000.0	1 000.0	1 000.0	1 000.0
Vencimiento de CD BCRP del 9 al 13 de octubre de 2023	1 985.1	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	4000.0 500.0 3665.0	3000.0 2250.0	2500.0 1930.0	2000.0 1050.0	1000.0 600.0 1000.0 2200.0
Procesadas recibidas	5530.0 1150.0 3665.0	4900.0 2250.0	3150.0 1930.0	2200.0 1050.0	3830.0 1300.0 2240.0 3950.0
Plazo de vencimiento	1 d 7 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 91 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	7.51 7.60 7.50	7.52 7.50	7.52 7.50	7.51 7.50	7.31 7.35 7.34 7.32
Máxima	7.60 7.60 7.60	7.58 7.53	7.57 7.53	7.57 7.52	7.35 7.40 7.40 7.37
Promedio	7.57 7.60 7.57	7.55 7.53	7.54 7.50	7.54 7.51	7.33 7.38 7.37 7.34
Saldo	21 357.2	18 442.2	17 122.2	15 242.2	15 892.2
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 9 de Octubre del 2023	8 165.0	5 750.0	4 930.0	4 150.0	4 200.0
Vencimiento de Repo Valores del 9 al 13 de octubre de 2023	10 286.0	7 350.0	6 030.0	4 150.0	4 800.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Procesadas 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 9 al 13 de octubre de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 300.8	6 298.1	6 298.1	6 298.1	6 298.1
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 13 de Octubre del 2023	2.7	0.3	0.3	0.3	0.3
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 9 al 13 de octubre de 2023	2.7	0.0	0.0	0.0	0.3
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)					
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 Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)					
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 Compra Temporal de Valores (REPO Especial - CDR)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR					
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 9 al 13 de octubre de 2023					
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acceso de Liquidez					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez					
Vencimientos de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez del 9 al 13 de octubre de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Ajustables del BCR (CDV BCRP)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 9 al 13 de octubre de 2023					
x. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP					
Vencimiento de CDLD BCRP del 9 al 13 de octubre 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 9 al 13 de octubre de 2023					
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Procesadas 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 9 al 13 de octubre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	300.0
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 9 al 13 de octubre 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	1 808.0	1 808.0	1 808.0	1 808.0	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 9 al 13 de octubre 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 9 al 13 de octubre de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	532.0	372.0	372.0	372.0	372.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 11 de Octubre del 2023	160.0	25.0	25.0	25.0	25.0
Vencimiento de REPO del 9 al 13 de octubre de 2023	160.0	0.0	0.0	0.0	25.0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco					
Vencimiento de REPO del 9 al 13 de octubre de 2023					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 9 al 13 de octubre de 2023					
xix. Compra 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 9 al 13 de octubre de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300.0		200.0	200.0	
Procesadas recibidas	815.0		650.0	975.0	
Plazo de vencimiento	366 d		366 d	365 d	
Tasas de interés: Mínima	5.54		5.64	5.28	
Máxima	5.86		5.73	5.35	
Promedio	5.81		5.68	5.33	
Saldo	39 390.2	39 390.2	39 590.2	39 790.2	39 790.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 17 de Octubre del 2023	190.0	190.0	190.0	190.0	190.0
Vencimiento de SC - Venta del 9 al 13 de octubre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xxi. Subasta de Reco de Valores para proveer dólares (RED)					
Procesadas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 9 al 13 de octubre de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Procesadas 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 9 al 13 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.n	n.n	n.n	n.n	n.n
i. Compras (millones de US$)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
Tipo de cambio promedio	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
ii. Ventas (millones de US$)	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$)	0.4	1.2	1.7	1.7	0.1
i. Compras (millones de US$)	0.4	1.2	1.7	1.7	0.1
ii. Ventas (millones de US$)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	72.8	0.0	75.3	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	72.8	0.0	75.3	0.0	0.0
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**13 931,7**	**12 769,1**	**11 590,3**	**10 390,9**	**10 837,5**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0214%	0.0214%	0.0214%	0.0214%	0.0214%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0.0	0.0	277.0	261.0	213.0
Tasa de interés	4.75%	4.75%	4.75%	4.75%	4.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**13 931,7**	**12 769,1**	**11 613,3**	**10 129,9**	**10 424,5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 305.6	16 296.0	16 807.9	16 865.3	16 601.6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	6.0	7.9	8.1	8.2	8.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 397.1	9 658.9	10 170.8	10 228.2	9 964.6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	2.6	4.7	4.9	5.0	4.8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	653.0	1 379.0	1 114.0	1 721.0	1 459.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.50 / 7.50 / 7.50	7.50 / 7.50 / 7.50	7.50 / 7.50 / 7.50	7.50 / 7.50 / 7.50	7.25 / 7.25 / 7.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	77.0	77.0	79.0	90.0	114.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	K.K0 / K.K0 / K.K0	K.K0 / K.K0 / K.K0	K.K0 / K.K0 / K.K0	K.K0 / K.K0 / K.K0	K.K0 / K.K0 / K.K0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR 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$)	**Set 29 2023**	**Oct.02 2023**	**Oct.03 2023**	**Oct.04 2023**	**Oct.05 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + o	-48.9	51.7	22.0	-61.1	45.8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + o	339.2	94.0	-11.3	-20.3	-13.7
a. Mercado spot con el público	100.4	123.1	-8.4	-7.0	-5.0
i. Compras	845.1	492.9	372.7	550.5	446.7
ii. (-) Ventas	744.7	369.8	381.1	557.5	451.7
b. Compras forward y swap al público (con v sin entrega)	-29.7	-14.0	238.7	64.5	-188.6
i. Pactadas	291.9	118.0	385.2	219.0	166.1
ii. (-) Vencidas	321.6	132.0	146.4	154.5	354.8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	476.7	107.6	199.4	155.3	-197.9
i. Pactadas	598.8	358.4	509.7	536.4	485.5
ii. (-) Vencidas	122.1	250.8	310.4	381.1	683.4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	566.5	303.0	483.4	440.8	403.8
ii. A futuro	0.0	38.0	53.0	76.0	27.0
e. Operaciones swot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entregas	-42.3	124.5	162.5	226.7	320.6
i. Compras	116.9	240.0	308.8	379.6	673.6
ii. (-) Ventas	159.2	115.5	146.3	152.9	353.0
f. Efecto de Opciones	4.2	0.5	-5.2	-2.3	-2.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	195.8	44.0	-1.4	39.0	51.6
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7929	3.8007	3.8118	3.8171	3.8256
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera