BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	09 Oct 23	10 Oct 23	11 Oct 23	12 Oct 23	13 Oct 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**7 237.6**	**8 242.9**	**8 533.6**	**9 281.0**	**7 943.0**
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	21 651.5	21 651.5	21 651.5	21 651.5	21 651.5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de Octubre del 2023	1 000.0	1 000.0	1 000.0	1 000.0	1 000.0
Vencimiento de CD BCRP del 16 al 20 de octubre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	3 584.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1000.0 1900.0	500.0			599.9
Propuestas recibidas	3350.0 3920.0	1620.0			1600.0
Plazo de vencimiento	31 d 1 d	1 d			91 d
Tasas de interés: Mínima	7.43 7.40	7.45			7.41
Máxima	7.43 7.43	7.47			7.50
Promedio	7.43 7.42	7.46			7.47
Saldo	14 592.2	13 192.2	12 692.2	12 692.2	12 692.1
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 20 de Octubre del 2023	1 900.0	500.0	600.0	600.0	600.0
Vencimiento de Repo Valores del 16 al 20 de octubre de 2023	2 500.0	1 100.0	600.0	600.0	600.0
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 16 al 20 de octubre de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 298.1	6 298.1	6 298.1	6 298.1	6 297.8
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 3 de Enero del 2024	0.3	0.3	0.3	0.3	14.1
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 16 al 20 de octubre de 2023	0.3	0.3	0.3	0.3	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 Repo Especial - CDR del 16 al 20 de octubre de 2023					
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Apoyo de Liquidez					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez					
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 16 al 20 de octubre de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Márgen: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 16 al 20 de octubre 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 16 al 20 de octubre de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)				1 200.0	1 299.9
Propuestas recibidas				1 848.0	3 340.0
Plazo de vencimiento				1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima				6.07	6.60
Máxima				7.01	6.90
Promedio				6.95	6.87
Saldo				1 200.0	1 299.9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 16 de Octubre del 2023				1 200.0	1 299.9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 16 al 20 de octubre de 2023				1 200.0	1 299.9
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)		14.2			
Propuestas recibidas		437.3			
Plazo de vencimiento		183 d			
Tasas de interés: Mínima		7.15			
Máxima		7.16			
Promedio		7.18			
Saldo	6 769.4	6 483.6	6 483.6	6 483.6	6 483.6
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de Octubre del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 16 al 20 de octubre de 2023	300.0	0.0	0.0	0.0	300.0
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 16 al 20 de octubre de 2023					
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				300.0	
Propuestas recibidas				470.0	
Plazo de vencimiento				92 d	
Tasas de interés: Mínima				5.65	
Máxima				5.79	
Promedio				5.75	
Saldo	1 808.0	1 808.0	1 808.0	2 108.0	2 108.0
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 16 al 20 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)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 16 al 20 de octubre de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	372.0	372.0	347.0	347.0	347.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 27 de Octubre del 2023	25.0	25.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de REPO del 16 al 20 de octubre de 2023	25.0	25.0	0.0	0.0	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 Repo					
Vencimiento de REPO del 16 al 20 de octubre 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 Repo Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 16 al 20 de octubre de 2023					
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 16 al 20 de octubre de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0	300.0 200.0	200.0 200.0 200.0	200.0 300.0 150.0	200.0 300.0
Propuestas recibidas	345.0	835.0 471.0	740.0 563.0 544.0	765.0 814.0 150.0	395.0 640.0
Plazo de vencimiento	366 d	366 d 366 d	366 d 183 d 366 d	365 d 369 d 369 d	368 d 185 d
Tasas de interés: Mínima	6.35	6.35 6.40	6.45 6.45 6.46	6.44 6.46 6.74	6.60 6.96
Máxima	6.70	6.64 6.74	6.65 6.45 6.65	6.65 6.65 6.95	6.65 6.75
Promedio	6.53	6.54 6.68	6.57 6.45 6.60	6.61 6.65 6.85	6.60 6.85
Saldo	39 969.9	40 499.9		41 399.9	41 399.9
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 16 al 20 de octubre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	1 650.0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (REDI)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REDI					
Vencimiento de REDI del 16 al 20 de octubre de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Propuestas 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 16 al 20 de octubre de 2023					
b. Liquid. Repos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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$)	0.0	0.4	0.9	2.5	11.7
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.4	0.9	2.5	11.7
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	71.4	70.4	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	71.4	70.4	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**10 137.6**	**8 797.1**	**8 533.6**	**8 198.0**	**7 476.2**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Contratos (tipo cambio diario)	n.ó/n.ó%	n.ó/n.ó%	n.ó/n.ó%	n.ó/n.ó%	n.ó/n.ó%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	n.ó	n.ó	n.ó	n.ó	n.ó
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	72.0	171.0	653.0	1 814.0	1 518.6
Tasa de interés	4.50%	4.50%	4.50%	4.50%	4.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**10 065.6**	**8 886.1**	**7 880.6**	**6 384.0**	**5 957.6**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	16 794.7	16 754.4	16 478.9	16 223.9	15 854.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	8.1	8.1	8.0	7.9	7.7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	10 150.6	10 106.2	9 833.5	9 612.0	9 234.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	4.9	4.9	4.8	4.7	4.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 575.0	1 950.0	1 783.0	1 800.0	1 613.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.35 / 7.26
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	155.0	186.0	234.0	294.0	253.5
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$)	**Oct. 06 2023**	**Oct. 09 2023**	**Oct. 10 2023**	**Oct. 11 2023**	**Oct. 12 2023**
Plazo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f.i + g	-34.7	61.5	-206.0	4.9	241.8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	154.9	81.9	-54.0	-205.2	211.8
a. Mercado spot con el público	81.4	80.6	-43.1	-195.9	129.8
i. Compras	508.1	260.8	601.9	699.8	468.1
ii. (-) Ventas	424.7	180.2	645.1	895.7	338.3
b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega)	-274.4	12.9	-40.2	4.9	-154.8
i. Pactadas	149.7	21.0	351.6	278.3	162.9
ii. (-) Vencidas	424.1	8.1	391.8	273.4	317.4
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-86.2	84.1	245.4	-47.9	-21.4
i. Pactadas	510.2	105.0	573.4	408.4	408.2
ii. (-) Vencidas	596.4	20.9	328.0	456.3	429.6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	515.7	160.2	480.0	522.0	493.4
ii. A futuro	33.0	20.0	75.0	135.0	138.1
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entregas	247.6	10.3	-72.0	179.1	120.2
i. Compras	552.2	11.9	290.8	451.1	420.0
ii. (-) Ventas	304.6	1.6	362.8	272.0	299.8
f. Efecto de Opciones	-1.5	-1.2	2.7	0.4	-6.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-1.7	55.9	128.1	151.3	243.2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.8272	3.8390	3.8233	3.8248	3.8431

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera