BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	16 Oct 23	17 Oct 23	18 Oct 23	19 Oct 23	20 Oct 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**9 840,1**	**11 293,6**	**10 964,1**	**10 768,4**	**7 578,8**
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)			500.0	700.0	500.0
Procuestas recibidas			1694.0	2135.8	1483.0
Plazo de vencimiento			183 d	182 d	185 d
Tasas de interés: Mínima			6.75	6.70	6.67
Máxima			6.85	6.79	6.72	
Promedio			6.79	6.76	6.69	
Saldo	30 651.5	28 767.5	29 517.5	29 867.5	30 617.5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Noviembre del 2023	1 864.0	700.0	700.0	1 899.9	1 899.9
Vencimiento de CD BCRP del 23 al 27 de octubre de 2023	2 584.0	700.0	700.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	300.0	200.0			600.0
Procuestas recibidas	900.0	550.0			1100.0
Plazo de vencimiento	95 d	94 d			98 d
Tasas de interés: Mínima	7.30	7.31			7.30
Máxima	7.41	7.35			7.36
Promedio	7.36	7.33			7.32
Saldo	12 992.1	13 192.1	13 192.1	13 192.1	13 192.1
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 27 de Octubre del 2023	600.0	600.0	600.0	600.0	600.0
Vencimiento de Reco Valores del 23 al 27 de octubre de 2023	600.0	600.0	600.0	600.0	600.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Procuestas 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 23 al 27 de octubre de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 297.8	6 297.8	6 297.8	6 297.8	6 297.8
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 3 de Enero del 2024	14.1	14.1	14.1	14.1	14.1
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 23 al 27 de octubre de 2023	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					
Procuestas 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					
Procuestas 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)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR					
Vencimiento de Reco Especial - CDR del 23 al 27 de octubre de 2023					
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acceso de Liquidez					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco de Cartera para el Acceso de Liquidez del 23 al 27 de octubre de 2023					
Vencimiento de Reco de Cartera para el Acceso de Liquidez del 23 al 27 de octubre de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDV BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 23 al 27 de octubre de 2023					
x. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP					
Vencimiento de CDLD BCRP del 23 al 27 de octubre de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)			3 300.0	3 000.0 2 700.0	3 000.0 1 898.0
Procuestas recibidas			7 039.2	4 732.5 3 788.2	4 607.8 1 898.0
Plazo de vencimiento			1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima			6.49	6.50 6.50	6.69 6.53
Máxima			6.85	6.87 7.14	6.90 7.25
Promedio			6.79	6.79 6.79	6.83 6.91
Saldo			3 300.0	5 700.0	4 898.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 23 de Octubre del 2023			3 300.0	5 700.0	4 898.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 23 al 27 de octubre de 2023			3 300.0	5 700.0	4 898.0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					70.0
Procuestas recibidas					496.2
Plazo de vencimiento					95 d
Tasas de interés: Mínima					7.30
Máxima					7.31
Promedio					7.31
Saldo	6 483.6	6 483.6	6 483.6	6 483.6	6 253.6
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 24 de Octubre del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 23 al 27 de octubre de 2023	300.0	300.0	300.0	300.0	600.0
xiii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN del 23 al 27 de octubre de 2023					
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 108.0	2 108.0	2 108.0	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 23 al 27 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)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 23 al 27 de octubre de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	347.0	347.0	347.0	347.0	347.0
Próximo vencimiento de Repo Bancos el 27 de Octubre del 2023	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de REPO del 23 al 27 de octubre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0	30.0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco					
Vencimiento de REPO del 23 al 27 de octubre de 2023					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Excansion					
Vencimiento de REPO Excansión del 23 al 27 de octubre de 2023					
xix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 23 al 27 de octubre de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.1 300.0	300.0 Desierta	55.0 300.0		
Procuestas recibidas	395.0 458.0	605.0 - -	1040.0 475.0		
Plazo de vencimiento	274 d 274 d	366 d 274 d	92 d 366 d	365 d 274 d 368 d 92 d	
Tasas de interés: Mínima	5.38 5.45	5.85 -	5.62 5.81		
Máxima	5.70 5.80	5.84 -	5.70 5.90		
Promedio	5.56 5.71	5.77 -	5.67 5.87		
Saldo	42 740.3	42 850.3	43 050.3	43 309.3	43 649.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 23 de Octubre del 2023	160.0	200.0	500.0	760.0	300.0
Vencimiento de SC - Venta del 23 al 27 de octubre de 2023	1 650.0	1 460.0	1 260.0	760.0	2 909.9
xxi. Subasta de Reco de Valores sara orowser dólares (RED)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 23 al 27 de octubre de 2023					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Procuestas 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 23 al 27 de octubre de 2023					
b. Locat. 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	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	67.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	3.9
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.1	1.4	4.9	0.0	0.5
i. Compras (millones de US$)	0.1	1.4	4.9	0.0	0.5
ii. Ventas (millones de US$)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRPNR y RTP	40.6	0.0	73.6	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	40.6	0.0	73.6	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**10 140,1**	**11 493,6**	**7 890,8**	**5 934,1**	**3 551,8**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0208%	0.0208%	0.0208%	0.0208%	0.0208%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por reajustación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2 377.3	2 942.0	2 629.0	1 186.0	772.0
Tasa de interés	4.50%	4.50%	4.50%	4.50%	4.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**7 762,8**	**8 551,6**	**5 264,8**	**4 362,1**	**2 779,8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	15 218.8	15 275.8	15 313.8	14 960.3	14 715.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.4	7.4	7.4	7.2	7.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 599.2	8 656.2	8 694.2	8 340.7	8 095.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.2	4.2	4.2	4.0	3.9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 745.6	1 370.6	519.4	806.6	641.4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.25 / 7.40 / 7.28	7.00 / 7.35 / 7.25	6.50 / 7.25 / 6.97	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.25 / 7.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	271.0	273.0	226.0	200.0	196.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5.50 / 5.70 / 5.59	5.50 / 5.60 / 5.58	5.50 / 5.70 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.50 / 5.50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRPNR y RTP					
Plazo hasta 1 mes o menos (monto / tasa promedio)					
Plazo hasta 3 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. 13 2023**	**Oct. 16 2023**	**Oct. 17 2023**	**Oct. 18 2023**	**Oct. 19 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-26.4	-28.0	-40.5	4.0	-32.1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-34.6	31.9	-61.9	24.8	-59.8
a. Mercado spot con el público	0.0	77.1	-56.6	35.2	-44.2
i. Compras	456.3	531.1	339.3	933.2	391.5
ii. (-) Ventas	456.3	454.0	395.9	898.0	435.7
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	344.6	-91.4	37.9	-80.2	-221.8
i. Pactadas	400.0	266.1	165.9	105.0	283.2
ii. (-) Vencidas	55.4	357.5	128.1	185.2	505.0
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	462.6	90.0	42.5	-30.4	-179.0
i. Pactadas	559.0	500.8	810.6	295.9	479.3
ii. (-) Vencidas	96.4	410.8	768.1	326.3	658.2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	361.6	428.8	456.0	386.5	526.4
ii. A futuro	80.0	39.0	11.0	80.6	15.0
e. Operaciones sscf asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	23.6	24.8	644.0	140.5	143.0
i. Compras	68.6	369.4	766.4	324.7	643.2
ii. (-) Ventas	45.0	344.6	122.5	184.2	500.2
f. Efecto de Opciones	-3.5	-8.0	-1.5	-9.2	-1.8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	112.6	112.9	18.3	28.9	67.0
h. Crédito por reajustación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.8509	3.8598	3.8575	3.8696	3.8709
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera