BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	30 Oct 23	31 Oct 23	02 Nov 23	03 Nov 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**6 247.1**	**6 140.0**	**7 210.4**	**6 931.8**
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)	300.0			
Propuestas recibidas	565.0			
Plazo de vencimiento	188 d			
Tasas de interés: Mínima	6.66			
Máxima	6.69			
Promedio	6.67			
Saldo	33 434.5	33 434.5	33 434.5	33 434.5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Noviembre del 2023	1 899.9	1 899.9	1 899.9	1 899.9
Vencimiento de CD BCRP del 6 al 10 de noviembre de 2023	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			3000.0 500.0 2755.0	2000.0 50.0 500.0 2592.0
Propuestas recibidas			5585.0 1800.0 2755.0	4450.0 900.0 1200.0 2592.0
Plazo de vencimiento			1 d 7 d 1 d	3 d 98 d 7 d 3 d
Tasas de interés: Mínima			7.36 7.41 7.25	7.33 7.34 7.38 7.25
Máxima			7.45 7.41 7.43	7.40 7.34 7.39 7.29
Promedio			7.41 7.41 7.36	7.37 7.34 7.39 7.27
Saldo	13 042.1	13 042.1	19 297.1	19 084.1
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 6 de Noviembre del 2023	600.0	600.0	6 355.0	5 592.0
Vencimiento de Repo Valores del 6 al 10 de noviembre de 2023	600.0	600.0	6 355.0	8 192.0
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 6 al 10 de noviembre de 2023				
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativa)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	6 297.8	6 297.8	6 297.8	6 297.8
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativa el 3 de Enero del 2024	14.1	14.1	14.1	14.1
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativa del 6 al 10 de noviembre de 2023	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				
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
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
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 6 al 10 de noviembre de 2023				
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acervo de Liquidez				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Acervo de Liquidez				
Vencimiento de Repo de Cartera para el Acervo de Liquidez del 6 al 10 de noviembre de 2023				
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDV BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de CDV BCRP				
Vencimientos de CDV BCRP del 6 al 10 de noviembre 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 6 al 10 de noviembre de 2023				
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 903.5 1 430.7	2 000.0 3 173.8		
Propuestas recibidas	2 903.5 1 430.7	3 303.5 3 173.8		
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	2 d 2 d		
Tasas de interés: Mínima	7.00 7.00	7.00 6.99		
Máxima	7.25 7.25	7.10 7.25		
Promedio	7.18 7.18	7.10 7.25		
Saldo	4 334.2	5 173.8		
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	4 334.2	5 173.8		
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 6 al 10 de noviembre de 2023	4 334.2	5 173.8		
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	200.0	200.0	300.0	300.0
Propuestas recibidas	687.2	587.0	856.0	755.0
Plazo de vencimiento	32 d	36 d	35 d	38 d
Tasas de interés: Mínima	7.64	7.52	7.35	7.34
Máxima	7.64	7.59	7.57	7.39
Promedio	7.64	7.57	7.48	7.36
Saldo	6 153.6	6 353.6	6 353.6	6 353.6
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 8 de Noviembre del 2023	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 6 al 10 de noviembre de 2023	600.0	600.0	300.0	900.0
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 6 al 10 de noviembre de 2023				
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	2 108.0	2 108.0	2 108.0	1 978.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 7 de Noviembre del 2023	130.0	130.0	130.0	150.0
Vencimiento de CDR BCRP del 6 al 10 de noviembre de 2023	130.0	130.0	130.0	150.0
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 6 al 10 de noviembre de 2023				
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	317.0	317.0	317.0	317.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 10 de Noviembre del 2023	25.0	25.0	25.0	25.0
Vencimiento de REPO del 6 al 10 de noviembre de 2023	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 6 al 10 de noviembre de 2023				
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Excepción)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Reco Excepcion				
Vencimiento de REPO Excepción del 6 al 10 de noviembre 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 Reco Sustitucion				
Vencimiento de REPO Sustitución del 6 al 10 de noviembre de 2023				
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	170.0 20.0	300.0 Desierta 300.0 300.0 300.0		200.0
Propuestas recibidas	265.0 78.5	440.0 --- 1100.0 1070.0 800.0		319.0
Plazo de vencimiento	366 d 92 d	92 d 366 d 92 d 91 d 91 d		91 d
Tasas de interés: Mínima	5.79 5.74	5.73 - 5.65 5.59 5.56		5.59
Máxima	5.90 5.74	5.74 - 5.72 5.63 5.61		5.73
Promedio	5.87 5.74	5.74 - 5.69 5.61 5.59		5.64
Saldo	43 419.4	43 819.4	43 519.4	43 219.5
Próximo vencimiento de SC-Venta el 6 de Noviembre del 2023	800.0	300.0	499.9	525.0
Vencimiento de SC - Venta del 6 al 10 de noviembre de 2023	1 599.9	799.9	499.9	1 535.1
xxi. Subasta de Reco de Valores para ameser dólares (RED)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de RED				
Vencimiento de RED del 6 al 10 de noviembre 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 6 al 10 de noviembre de 2023				
b. Liquid. Recos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)	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
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	4.3	4.4	2.4	0.2
i. Compras (millones de US$)	4.3	4.4	2.5	0.2
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	73.2	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP (Valorizado)	73.2	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 821.1**	**2 289.5**	**13 788.4**	**12 323.8**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0208%	0.0208%	0.0208%	0.0208%
b. Compra temporal directa de valores (Ilarra de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés				
c. Crédito por reajustación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	943.0	1 118.5	370.0	577.0
Tasa de interés	4.50%	4.50%	4.50%	4.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 878.1**	**1 991.0**	**13 398.4**	**11 746.8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 672.3	12 542.2	12 366.6	14 696.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.1	6.1	6.0	10.6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 052.7	5 922.6	5 747.1	9 293.9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.9	2.9	2.8	6.7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 480.9	715.9	1 094.4	1 711.3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.25 / 7.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	159.0	99.0	49.0	63.5
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
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$)	**Oct.27 2023**	**Oct.30 2023**	**Oct.31 2023**	**Nov.02 2023**
Flujo de la posición global = a + b + c + d + e + f + g	-44.2	18.4	84.4	69.3
Flujo de la posición contable = a + b + c + e + g	-98.8	-26.4	-139.5	-79.3
a. Mercado spot con el público	-77.0	-6.6	-100.8	-44.9
i. Compras	478.9	752.6	289.8	421.2
ii. (-) Ventas	555.9	759.2	390.5	466.1
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	-176.1	89.1	95.8	-232.8
i. Pactadas	382.2	239.9	304.6	320.9
ii. (-) Vencidas	558.3	150.8	208.9	553.8
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	-290.0	-30.6	-37.9	-447.2
i. Pactadas	243.4	285.0	390.3	291.1
ii. (-) Vencidas	533.4	315.7	428.2	738.3
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	624.6	244.6	309.6	483.7
ii. A futuro	170.0	43.0	57.0	5.0
e. Operaciones swap asociadas a swaps o vencimientos de forwards sin entrega	-31.6	150.0	194.9	166.4
i. Compras	523.7	296.6	401.7	716.1
ii. (-) Ventas	555.3	146.6	207.1	549.7
f. Efecto de Opciones	6.7	10.7	-0.4	15.8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-81.1	-90.5	76.7	-97.9
h. Crédito por reajustación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.8578	3.8415	3.8363	3.7961
(*) Datos preliminares				

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera