BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	06 Nov 23	07 Nov 23	08 Nov 23	09 Nov 23	10 Nov 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 177,2**	**8 505,0**	**8 631,8**	**7 292,2**	**5 808,0**
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	22 242,5	22 242,5	22 242,5	22 242,5	22 242,5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Noviembre del 2023	1 899,9	1 899,9	1 899,9	1 899,9	1 899,9
Vencimiento de CD BCRP del 13 al 17 de noviembre de 2023	0,0	0,0	0,0	0,0	5 024,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1000,0 2845,0	1000,0 1500,0	247,0	1300,0	500,0 75,0 600,0 1200,0
Propuestas recibidas	3092,0 2845,0	1100,0 2097,0	247,0	1397,0	1597,0 175,0 1975,0 2457,0
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	7 d 1 d	1 d	1 d	3 d 91 d 31 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	7,35 7,25	7,25 7,37	7,26	7,41	7,21 6,90 7,26 7,37
Máxima	7,41 7,31	7,38 7,37	7,32	7,41	7,21 7,10 7,38 7,37
Promedio	7,39 7,28	7,32 7,37	7,30	7,41	7,21 7,03 7,33 7,37
Saldo	16 337,1	14 992,1	12 739,1	12 292,1	12 267,1
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 13 de Noviembre del 2023	3 845,0	2 500,0	1 747,0	2 400,0	1 700,0
Vencimiento de Repo Valores del 13 al 17 de noviembre de 2023	6 445,0	5 100,0	2 847,0	2 400,0	2 300,0
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 13 al 17 de noviembre de 2023					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 297,8	6 297,8	6 297,8	6 297,8	6 297,8
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 3 de Enero del 2024	14,1	14,1	14,1	14,1	14,1
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 13 al 17 de noviembre 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					
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 13 al 17 de noviembre de 2023					
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acceso de Liquidez					
Propuestas 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 13 al 17 de noviembre de 2023					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 13 al 17 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 13 al 17 de noviembre de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 13 al 17 de noviembre de 2023					
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)			300,0	112,0	299,9
Propuestas recibidas			765,4	454,2	648,2
Plazo de vencimiento			34 d	35 d	35 d
Tasas de interés: Mínima			7,45	7,45	7,45
Máxima			7,45	7,45	7,45
Promedio			7,45	7,45	7,45
Saldo	6 353,6	6 353,6	6 353,6	6 165,6	6 165,5
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 13 de Noviembre del 2023	300,0	300,0	300,0	300,0	232,7
Vencimiento de Coloc-TP del 13 al 17 de noviembre de 2023	900,0	900,0	600,0	300,0	732,7
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 13 al 17 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	1 978,0	1 828,0	1 828,0	1 828,0	1 828,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 21 de Diciembre del 2023	150,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de CDR BCRP del 13 al 17 de noviembre de 2023	150,0	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 13 al 17 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	292,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 28 de Noviembre del 2023	25,0	25,0	25,0	25,0	30,0
Vencimiento de REPO del 13 al 17 de noviembre de 2023	25,0	25,0	25,0	25,0	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 13 al 17 de noviembre 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 13 al 17 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 Repo Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 13 al 17 de noviembre de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	500,0 48,0	500,0 400,0	300,0 600,0 130,0	300,0 400,0	125,0 200,0 Desierta
Propuestas recibidas	986,0 48,0	1025,0 595,0	640,0 1082,0 135,0	350,0 1015,0	340,0 465,0
Plazo de vencimiento	92 d 92 d	92 d 93 d	274 d 91 d 275 d	95 d 95 d	95 d 273 d 95 d
Tasas de interés: Mínima	6,49 6,75	6,74 6,74	6,69 6,77 6,48	6,78 6,45	6,75 6,79 -
Máxima	6,80 6,84	6,84 6,84	6,77 6,84 6,80	6,80 6,79	6,85 6,84 -
Promedio	6,78 6,81	6,76 6,81	6,74 6,75 6,45	6,45 6,69	6,78 6,82 -
Saldo	43 240,5	40 740,4	44 579,4	44 979,4	46 597,4
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de Noviembre del 2023	400,1	200,0	400,0	10,0	680,0
Vencimiento de SC - Venta del 13 al 17 de noviembre de 2023	1 010,1	610,0	410,0	10,0	1 880,0
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 13 al 17 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 13 al 17 de noviembre de 2023					
b. Usual: 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	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$)	0,1	0,0	0,0	0,0	8,3
i. Compras (millones de US$)	0,1	0,0	0,0	0,0	8,3
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	10,4	0,0	49,7	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	10,4	0,0	49,7	0,0	0,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**12 922,2**	**11 005,0**	**9 183,8**	**8 642,2**	**8 472,9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
(Vencimiento Tasa efectiva diaria)	n.ooooo%	n.ooooo%	n.ooooo%	n.ooooo%	n.ooooo%
b. Compra temporal directa de valores (Repo de subasta)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	867,0	809,0	1 020,0	300,0	183,0
Tasa de interés	4,50%	4,50%	4,50%	4,50%	4,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**11 186,2**	**10 196,0**	**8 143,8**	**8 342,2**	**8 289,9**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	16 802,4	16 847,8	16 716,0	16 264,1	16 147,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	8,1	8,2	8,1	7,9	7,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	10 245,6	10 291,0	10 158,3	9 707,3	9 590,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	5,0	5,0	4,9	4,7	4,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 748,0	1 208,0	987,5	1 307,0	2 193,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7.25 / 7.25 / 7.25	7.25 / 7.25 / 7.25	7.00 / 7.25 / 7.20	7.25 / 7.25 / 7.25	7.00 / 7.00 / 7.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	87,0	71,0	43,0	82,0	77,0
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$)	**Nov.03 2023**	**Nov.06 2023**	**Nov.07 2023**	**Nov.08 2023**	**Nov.09 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e.f + f + g	-104,3	26,9	35,5	53,5	-91,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-137,1	20,4	-59,8	64,8	89,1
a. Mercado spot con el público	-53,5	35,5	-11,4	107,2	79,0
i. Compras	484,1	705,0	419,3	401,0	400,2
ii. (-) Ventas	537,6	669,6	430,7	293,8	321,2
b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega)	180,0	101,9	92,0	-31,9	-340,5
i. Pactadas	229,3	330,0	318,3	243,0	162,3
ii. (-) Vencidas	49,3	228,0	226,4	334,9	502,8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	102,4	98,6	117,0	127,4	-84,2
i. Pactadas	252,6	340,2	405,9	647,1	571,2
ii. (-) Vencidas	150,3	241,6	288,9	519,7	655,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	427,2	451,4	383,8	1057,4	711,3
ii. A futuro	100,1	162,0	10,0	268,0	10,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entregas	67,6	13,9	58,7	142,6	163,4
i. Compras	112,3	229,1	282,7	475,6	649,5
ii. (-) Ventas	44,6	215,2	226,0	333,0	486,2
f. Efecto de Opciones	36,8	-0,3	-9,7	-11,5	-4,9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-131,8	-11,9	87,5	219,3	80,3
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,7348	3,7615	3,7754	3,7974	3,7947

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera