BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	27 Nov 23	28 Nov 23	29 Nov 23	30 Nov 23	01 Dic 23
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**5 593.5**	**5 706.2**	**5 544.0**	**5 731.5**	**4 151.4**
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	500.0		
Propuestas recibidas		987.3	1 402.3		
Plazo de vencimiento		182 d	181 d		
Tasas de interés: Mínima		6,44	6,42		
Máxima		6,45	6,43		
Promedio		6,44	6,42		
Saldo	32 136.9	32 603.4	33 211.6	33 211.6	33 211.6
Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de Noviembre del 2023		1 500.0	1 500.0		1 500.0
Vencimiento de CD BCRP del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023		0.0	0.0		0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					3500,0 300,0 500,0 500,0 1460,0
Propuestas recibidas					5429,0 400,0 825,0 540,0 1460,0
Plazo de vencimiento					3 d 91 d 33 d 6 d 3 d
Tasas de interés: Mínima					7,05 6,90 7,10 7,05 7,0
Máxima					7,34 6,90 7,10 7,05 7,20
Promedio					7,28 6,90 7,10 7,05 7,08
Saldo	10 517.1	10 517.1	10 517.1	10 517.1	16 177.1
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 1 de Diciembre del 2023		600.0	600.0		4 960.0
Vencimiento de Repo Valores del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023		600.0	600.0		5 950.0
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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023			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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 000,0 2 436,9	3 000,0 1 619,9	2 500,0 2 591,4	2 500,1 2 103,2	
Propuestas recibidas	2 656,0 2 436,9	3 497,0 1 619,9	3 920,6 2 591,4	3 573,1 2 103,2	
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	
Tasas de interés: Mínima	6,79 6,70	6,80 6,78	6,80 6,80	6,76 6,78	
Máxima	6,96 7,00	7,00 7,00	6,99 7,00	6,99 7,00	
Promedio	6,90 6,90	6,95 6,95	6,94 6,94	6,92 6,90	
Saldo	4 436.9	4 619.9	5 091.4	4 603.3	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 27 de Noviembre del 2023		4 619.9	5 091.4		
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023		4 619.9	5 091.4		
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0		300.0		173.0
Propuestas recibidas	765.4		646.6		323.0
Plazo de vencimiento	30 d		30 d		33 d
Tasas de interés: Mínima	7,05		7,05		7,00
Máxima	7,10		7,11		7,15
Promedio	7,07		7,07		7,05
Saldo	6 374.7	6 374.7	6 537.8	6 537.8	6 510.8
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Noviembre del 2023		136.9	200.0		500.0
Vencimiento de Coloc-TP del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023		336.9	200.0		1 300.0
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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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	1 828.0	1 828.0	1 828.0	1 828.0	1 828.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 21 de Diciembre del 2023		300.0	300.0		300.0
Vencimiento de CDR BCRP del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023			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 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	292.0	262.0	262.0	262.0	262.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 28 de Noviembre del 2023		20.0	20.0		20.0
Vencimiento de REPO del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023			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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		Desierta	70.0	300.0	300.0 Desierta 170.0
Propuestas recibidas		-.-	70,0	370,0	515,0 -.- 182,0
Plazo de vencimiento		92 d	92 d	182 d	186 d 367 d 277 d
Tasas de interés: Mínima		0,00	5,88	5,84	5,95 - 5,84
Máxima		0,00	5,97	5,99	5,99 - 5,94
Promedio		0,00	5,93	5,91	5,98 - 5,89
Saldo	44 657.8	44 457.8	44 327.8	44 377.8	44 247.8
Próximo vencimiento de SC-Venta el 28 de Noviembre del 2023		200.0	250.0		200.0
Vencimiento de SC - Venta del 27 de noviembre al 1 de diciembre de 2023		1 050.0	850.0		1 398.0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 27 de noviembre al 1 de diciembre 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 27 de noviembre al 1 de diciembre 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	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$)	3.8	0.6	-36.3	-7.3	-9.4
i. Compras (millones de US$)	3.8	0.6	0.8	2.7	4.6
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	37.1	10.0	14.1
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	89.5	0.0	91.7	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	89.5	0.0	91.7	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 726.0**	**2 155.6**	**1 584.1**	**2 389.1**	**10 544.0**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0201%	0.0201%	0.0201%	0.0201%	0.0201%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	825.0	495.0	329.0	708.8	468.0
Tasa de interés	4.25%	4.25%	4.25%	4.25%	4.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 901.0**	**1 660.6**	**1 255.1**	**1 680.3**	**10 076.0**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13 030.8	12 867.5	12 698.8	12 522.4	12 397.9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.3	6.2	6.2	6.1	6.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 474.5	6 311.1	6 142.5	5 966.1	5 841.5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.1	3.1	3.0	2.9	2.8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 183.0	1 023.0	1 123.0	1 071.8	1 212.2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	7,00 / 7,00 / 7,00	7,00 / 7,00 / 7,00	7,00 / 7,00 / 7,00	7,00 / 7,00 / 7,00	7,00 / 7,00 / 7,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	86.0	111.0	8.0	8.5	41.5
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$)	**Nov.24 2023**	**Nov.27 2023**	**Nov.28 2023**	**Nov.29 2023**	**Nov.30 2023**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-46.7	-35.9	-10.7	10.6	45.7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-34.5	-43.5	160.1	139.5	181.0
a. Mercado spot con el público	-24.9	-33.3	173.7	155.1	184.1
i. Compras	899.9	706.6	684.0	736.5	1182.4
ii. (-) Ventas	924.8	739.9	510.3	581.4	998.4
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	43.1	88.9	-28.8	252.5	-212.9
i. Pactadas	139.3	131.4	556.7	293.5	225.2
ii. (-) Vencidas	96.2	42.5	585.5	41.0	438.1
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-24.6	86.0	89.2	344.4	-63.9
i. Pactadas	590.1	202.1	653.8	464.8	396.3
ii. (-) Vencidas	614.6	116.1	564.6	120.3	460.2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	296.3	314.3	596.8	367.9	551.7
ii. A futuro	75.0	58.0	108.0	76.0	40.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	513.3	69.1	-26.5	62.1	24.4
i. Compras	590.2	108.2	557.4	102.2	458.1
ii. (-) Ventas	76.8	39.1	583.9	40.1	433.7
f. Efecto de Opciones	3.2	4.7	-0.3	-1.5	1.4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-87.6	-5.7	-60.5	-33.9	7.0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera

Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7327	3.7201	3.7299	3.7331	3.7363
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera