BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	28 Oct 24	29 Oct 24	30 Oct 24	31 Oct 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 318,7**	**8 894,8**	**8 505,7**	**5 268,0**
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)	300,0	50,0 100,0 400,0	30,0 300,0	
Propuestas recibidas	1200,0	142,5 205,0 1185,2	61,2 425,0	
Plazo de vencimiento	92 d	358 d 183 d 91 d	540 d 268 d	
Tasas de interés: Mínima	4,80	4,38 4,58 4,85	4,27 4,50	
Máxima	4,87	4,38 4,61 4,90	4,27 4,50	
Promedio	4,86	4,38 4,60 4,86	4,27 4,50	
Saldo	35 640,9	36 393,1	36 723,2	36 723,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 8 de Noviembre del 2024	900,0	900,0	900,0	900,0
Vencimiento de CD BCRP del 4 al 8 de noviembre de 2024	0,0			0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				600,0
Propuestas recibidas				1300,0
Plazo de vencimiento				92 d
Tasas de interés: Mínima				5,40
Máxima				5,46
Promedio				5,44
Saldo	9 085,5	9 085,5	9 085,5	9 260,5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 4 de Noviembre del 2024	650,0	650,0	650,0	150,0
Vencimiento de Repo Valores del 4 al 8 de noviembre de 2024	650,0	650,0	650,0	0,0
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 4 al 8 de noviembre de 2024				
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	3 846,4	3 846,4	3 846,4	3 846,4
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 4 de Noviembre del 2024	284,5	284,5	284,5	284,5
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 4 al 8 de noviembre de 2024				
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 4 al 8 de noviembre de 2024				
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 4 al 8 de noviembre de 2024				
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 4 al 8 de noviembre de 2024				
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 4 al 8 de noviembre de 2024				
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 499,9 500,0 2916,7	4 000,1 3 500,0	4 000,0 2 977,7	2 499,9 2 354,8
Propuestas recibidas	4 604,0 1 192,4 2916,7	5 551,0 3 795,0	5 588,9 2 977,7	2 705,6 2 354,8
Plazo de vencimiento	1 d 7 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	4 d 4 d
Tasas de interés: Mínima	4,85 4,88 4,85	4,85 4,85	4,85 4,85	4,85 4,85
Máxima	5,00 5,00 5,25	5,15 5,25	5,23 5,25	5,23 5,25
Promedio	4,94 4,94 5,02	5,05 5,10	5,15 5,15	5,12 5,17
Saldo	6 916,6	8 500,1	7 977,7	5 354,7
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 4 de Noviembre del 2024	5 916,6	7 500,1	7 477,7	5 354,7
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 4 al 8 de noviembre de 2024	6 416,6	8 000,1	7 477,7	0,0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)				200,0 300,0
Propuestas recibidas				689,7 892,0
Plazo de vencimiento				92 d 36 d
Tasas de interés: Mínima				5,19 5,37
Máxima				5,40 5,41
Promedio				5,21 5,40
Saldo	1 700,0	1 700,0	1 700,0	1 900,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 5 de Noviembre del 2024	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 4 al 8 de noviembre de 2024	300,0	300,0	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 4 al 8 de noviembre de 2024				
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de CDR BCRP				
Vencimiento de CDR BCRP del 4 al 8 de noviembre de 2024				
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 4 al 8 de noviembre de 2024				
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo Regular				
Vencimiento de REPO del 4 al 8 de noviembre de 2024				
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 4 al 8 de noviembre de 2024				
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 4 al 8 de noviembre de 2024				
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 4 al 8 de noviembre de 2024				
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200,0 200,0	120,0 200,0	300,1 115,0 150,0	200,0 Desierta 200,0
Propuestas recibidas	676,0 740,0	220,0 300,0	480,0 315,0 276,0	243,0 -.- 549,0
Plazo de vencimiento	98 d 182 d	98 d 182 d	97 d 182 d 273 d	97 d 365 d 96 d
Tasas de interés: Mínima	5,03 4,78	5,10 4,80	5,09 4,81 4,68	5,03 - 4,80
Máxima	5,03 4,83	5,14 4,80	5,15 4,89 4,70	5,14 - 4,88
Promedio	5,03 4,80	5,13 4,80	5,13 4,86 4,69	5,09 - 4,84
Saldo	49 168,3	49 088,3	48 873,4	48 873,4
Próximo vencimiento de SC-Venta el 4 de Noviembre del 2024	400,0	780,0	400,0	528,5
Vencimiento de SC - Venta del 4 al 8 de noviembre de 2024	1 580,0	1 180,0	400,0	
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 4 al 8 de noviembre de 2024				
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 4 al 8 de noviembre de 2024				
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
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$)	1,7	2,4	0,0	0,0
i. Compras (millones de US$)	1,7	2,4	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	76,6	0,0	102,6	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP (Valorizado)	76,6		102,6	0,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3 277,6**	**1 717,8**	**2 189,1**	**2 948,3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0162%	0,0162%	0,0162%	0,0162%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés				
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	386,0	42,8	253,9	1 001,5
Tasa de interés	3,25%	3,25%	3,25%	3,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2 891,6**	**1 675,0**	**1 935,2**	**1 946,8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13 255,2	13 122,0	12 930,3	12 807,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,8	5,7	5,7	5,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 385,7	6 206,7	6 015,1	5 891,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,8	2,7	2,6	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 658,0	803,0	1 101,4	690,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	5,00 / 5,25 / 5,20	5,25 / 5,25 / 5,25	5,25 / 5,25 / 5,25	5,25 / 5,25 / 5,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	58,0	67,0	47,0	15,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00
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. 25 2024**	**Oct. 28 2024**	**Oct. 29 2024**	**Oct. 30 2024**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	46,5	-77,3	78,0	14,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-46,3	-117,0	18,1	64,3
a. Mercado spot con el público	-14,4	-84,5	18,9	84,3
i. Compras	586,7	1026,9	614,6	553,2
ii. (-) Ventas	601,2	1111,4	595,7	468,9
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	152,8	79,3	-25,1	-256,3
i. Pactadas	201,6	250,7	447,6	170,8
ii. (-) Vencidas	48,8	171,4	472,7	427,1
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	133,5	39,2	-106,2	-264,2
i. Pactadas	400,4	410,0	880,6	730,6
ii. (-) Vencidas	266,9	370,8	986,8	994,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	483,6	339,6	637,6	568,6
ii. A futuro	120,0	96,0	205,0	135,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	184,8	177,2	515,1	563,1
i. Compras	227,2	341,9	983,1	976,3
ii. (-) Ventas	42,4	164,7	468,0	413,1
f. Efecto de Opciones	-0,4	-4,2	-0,1	-1,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	75,3	-6,4	-22,9	-72,3
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)	3,7572	3,7734	3,7695	3,7744
(*) Datos preliminares				

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera