BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	04 Nov 24	05 Nov 24	06 Nov 24	07 Nov 24	08 Nov 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**9 270,7**	**9 390,2**	**8 723,5**	**8 608,3**	**8 156,6**
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	200.0	20.0 300.0	20.0	200.0	299.8
Plazo de vencimiento	468.0	42.5 575.0	31.2	756.7	1130.0
Tasas de interés: Mínima	98 d	304 d 97 d	547 d	95 d	97 d
Máxima	4.81	4.35 4.79	4.20	4.82	4.65
Promedio	4.89	4.35 4.88	4.26	4.87	4.85
Saldo	37 024.3	37 569.3	37 590.6	37 786.6	37 340.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de Noviembre del 2024	900.0	900.0	900.0	900.0	1 952.3
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 15 de noviembre de 2024	900.0	900.0	900.0	900.0	5 351.9
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2500.0 2800.0	2000.0 2600.0	2000.0 2000.0	1000.0 2599.9	600.0 1400.0
Propuestas recibidas	9400.0 8540.0	3600.0 5100.0	3700.0 3160.0	1570.0 5140.0	1700.0 3100.0
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	01 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	6.77 6.96	5.29 5.29	5.37 5.37	5.29 5.25	5.18 5.00
Máxima	5.31 5.31	5.31 5.30	5.30 5.30	5.30 5.28	5.22 5.08
Promedio	5.29 5.30	5.30 5.29	5.29 5.29	5.29 5.27	5.20 5.04
Saldo	14 410.5	13 710.5	12 560.5	11 910.4	10 160.5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 11 de Noviembre del 2024	5 300.0	5 150.0	4 250.0	3 749.9	1 550.0
Vencimiento de Repo Valores del 11 al 15 de noviembre de 2024	6 250.0	5 550.0	4 400.0	3 749.9	2 000.0
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 11 al 15 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	3 561.9	3 561.9	3 363.2	3 363.2	3 363.2
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 11 de Noviembre del 2024	198.8	198.8	280.0	280.0	280.0
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 11 al 15 de noviembre de 2024					340.0
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 11 al 15 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 11 al 15 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 11 al 15 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 11 al 15 de noviembre de 2024					
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 11 al 15 de noviembre de 2024					
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 900.0	1 600.0	1 600.0	1 600.0	2 040.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 13 de Noviembre del 2024	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 11 al 15 de noviembre de 2024	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 11 al 15 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 11 al 15 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 11 al 15 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 11 al 15 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 11 al 15 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 Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 11 al 15 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 Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 11 al 15 de noviembre de 2024					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	170.0 Desierta 300.0	400.0	400.0 100.0	300.0 Desierta	300.0 200.0 Desierta
Propuestas recibidas	200.0 -- 900.0	1137.8	809.0 260.0	420.0 --	
Plazo de vencimiento	93 d 273 d 94 d	93 d	93 d 365 d	95 d 365 d	95 d 273 d 364 d
Tasas de interés: Mínima	5.13 - 4.70	5.04	5.04 4.42	5.04 -	4.98 4.57 -
Máxima	5.14 - 4.81	5.10	5.09 4.42	5.11 -	5.03 4.67 -
Promedio	5.13 - 4.75	5.08	5.05 4.42	5.07 -	4.99 4.62 -
Saldo	48 814.9	48 814.9	48 844.9	48 604.9	48 440.8
Próximo vencimiento de SC-Venta el 12 de Noviembre del 2024	400.0	470.0	540.0	664.1	360.0
Vencimiento de SC - Venta del 11 al 15 de noviembre de 2024	2 074.1	1 674.1	1 204.1	664.1	1 660.0
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 REDO del 11 al 15 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 11 al 15 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	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$)	0.1	1.9	0.3	-222.6	0.2
i. Compras (millones de US$)	0.1	1.9	0.3	0.4	0.2
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	223.0	0.0
e. Operaciones en el mercado secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	79.5	0.0	97.9	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Monto bruto)	79.5		97.9	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**14 373,7**	**13 720,2**	**12 713,5**	**12 094,9**	**10 352,3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	0.0162%	0.0162%	0.0162%	0.0147%	0.0146%
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Compra temporal directa de valores (Repo de subasta)					
Tasa de interés					
c. Crédito por recaudación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0.0	300.0	428.9	577.7	351.2
Tasa de interés	5.50%	5.50%	5.50%	5.50%	5.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**14 373,7**	**13 420,2**	**12 284,7**	**11 477,2**	**10 001,1**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (1)	12 884.2	13 339.1	14 633.9	15 156.3	15 450.7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (1)	5.0	5.0	5.0	5.0	5.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 769.0	6 917.6	7 842.4	8 314.8	8 609.2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (1)	2.5	3.0	3.4	3.6	3.7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 286.0	1 831.6	1 046.8	1 312.0	1 489.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25	5.25 / 5.25 / 5.25	5.00 / 5.00 / 5.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	22.0	72.0	25.0	40.0	67.0
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	4.75 / 4.75 / 4.75
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. 31 2024**	**Nov. 04 2024**	**Nov.05 2024**	**Nov. 06 2024**	**Nov.07 2024**
Flujo de la posición diaria: = a + b - c - d + e + f + g	-26.8	-51.8	-39.2	110.1	-89.6
Flujo de la posición contable: = a + b - c - d + e + g	135.4	40.0	118.5	308.1	-158.0
a. Mercado spot con el público	183.7	85.4	130.7	316.6	-108.4
i. Compras	1243.7	786.5	465.0	601.5	509.0
ii. (-) Ventas	1060.1	701.1	334.4	284.9	617.4
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	1.7	23.8	-88.6	102.6	-71.8
i. Pactadas	145.0	120.8	122.5	269.1	393.9
ii. (-) Vencidas	143.3	97.1	191.1	166.5	465.7
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	171.8	100.4	89.6	306.8	-188.5
i. Pactadas	453.6	621.7	525.1	766.7	637.0
ii. (-) Vencidas	281.8	521.3	435.4	459.9	825.5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	182.3	296.7	369.9	349.2	341.2
ii. (-) Activas	41.0	158.0	30.0	58.0	160.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	133.1	408.2	232.1	294.8	320.1
i. Compras	267.1	497.4	419.2	453.1	780.1
ii. (-) Ventas	134.0	89.2	187.1	158.5	460.0
f. Efecto de Opciones	6.5	1.6	-1.7	-2.8	11.5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-41.5	-46.2	2.4	-0.7	-69.7
h. Crédito por recaudación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7668	3.7656	3.7761	3.7861	3.7522

(1*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera