BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	03 Ene 24			04 Ene 24			05 Ene 24		
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 178,7**			**9 853,9**			**9 486,7**		
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	24 896.0			24 896.0			24 896.0		
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Enero del 2024	200.0			200.0			200.0		
Vencimiento de CD BCRP del 8 al 12 de enero de 2024	0.0			0.0			200.0		
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2000.0	300.0	1950.0	2000.0	500.0	640.0	1000.0	600.0	1220.0
Propuestas recibidas	4720.0	300.0	1950.0	3810.0	850.0	640.0	2430.0	680.0	1220.0
Plazo de vencimiento	1 d	33 d	1 d	1 d	7 d	1 d	3 d	91 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	6.81	6.83	6.75	6.81	6.78	6.76	6.82	6.85	6.75
Máxima	6.83	7.02	6.84	6.83	6.85	6.82	6.87	6.76	6.84
Promedio	6.81	6.91	6.80	6.81	6.79	6.76	6.84	6.74	6.80
Saldo	14 782.1			13 472.1			13 052.1		
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 8 de Enero del 2024	4 450.0			3 240.0			2 720.0		
Vencimiento de Repo Valores del 8 al 12 de enero de 2024	5 050.0			3 240.0			3 819.0		
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 8 al 12 de enero de 2024									
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento									
Tasas de interés: Mínima									
Máxima									
Promedio									
Saldo	6 257.5			6 257.5			6 257.5		
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 22 de Enero del 2024	1.5			1.5			1.5		
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 8 al 12 de enero de 2024	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		
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		
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 8 al 12 de enero 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 8 al 12 de enero 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 8 al 12 de enero 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 8 al 12 de enero 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 8 al 12 de enero de 2024									
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.1						300.0		
Propuestas recibidas	541.5						581.4		
Plazo de vencimiento	33 d						32 d		
Tasas de interés: Mínima	4.84						4.90		
Máxima	4.94						4.95		
Promedio	4.87						4.87		
Saldo	5 271.9			5 152.3			5 152.3		
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 8 de Enero del 2024	119.6			300.0			220.0		
Vencimiento de Coloc-TP del 8 al 12 de enero de 2024	419.6			300.0			770.0		
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 8 al 12 de enero 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	530.0			530.0			530.0		
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 12 de Enero del 2024	300.0			300.0			300.0		
Vencimiento de CDR BCRP del 8 al 12 de enero de 2024	0.0			0.0			300.0		
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 8 al 12 de enero de 2024									
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento									
Tasas de interés: Mínima									
Máxima									
Promedio									
Saldo	227.0			227.0			227.0		
Próximo vencimiento de Repo Regular el 9 de Enero del 2024	20.0			20.0			20.0		
Vencimiento de REPO del 8 al 12 de enero de 2024	0.0			0.0			20.0		
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 8 al 12 de enero 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 Reco Expansion									
Vencimiento de REPO Expansión del 8 al 12 de enero 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 Reco Sustitucion									
Vencimiento de REPO Sustitución del 8 al 12 de enero de 2024									
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0	200.0	300.0	300.0					
Propuestas recibidas	650.0	790.0	724.0	480.0					
Plazo de vencimiento	274 d	366 d	366 d	369 d					
Tasas de interés: Mínima	4.96	4.97	4.99	4.97					
Máxima	4.96	4.99	4.99	4.99					
Promedio	4.96	4.98	4.11	4.99					
Saldo	45 975.8			45 975.8			45 975.8		
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 de Enero del 2024	400.0			400.0			400.0		
Vencimiento de SC - Venta del 8 al 12 de enero de 2024	0.0			0.0			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 8 al 12 de enero 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 8 al 12 de enero de 2024									
b. Liquid. Repos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)	0.0			0.0			0.0		
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0			0.0			0.0		
i. Compras (millones de US$)	0.0			0.0			0.0		
Tipo de cambio promedio	0.0			0.0			0.0		
ii. Ventas (millones de US$)	0.0			0.0			0.0		
Tipo de cambio promedio	7.4			0.9			0.8		
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	7.4			0.9			0.8		
i. Compras (millones de US$)	0.0			0.0			0.0		
ii. Ventas (millones de US$)	0.0			0.0			0.0		
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP									
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR									
ii. Compras de BTP (Valorizado)									
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**12 720.0**			**12 993.9**			**12 587.8**		
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones									
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	0.00%			0.00%			0.00%		
(Promedio Tasa efectiva diaria)	0.0			0.0			0.0		
b. Compra temporal directa de valores (Repo de subasta)									
Tasa de interés									
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional									
Tasa de interés									
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	323.0			330.0			149.0		
Tasa de interés	4.00%			4.00%			4.00%		
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**12 397.0**			**12 663.9**			**12 438.8**		
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 708.1			13 984.1			15 191.0		
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.0			6.6			7.2		
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 050.0			6 896.8			8 103.6		
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.9			3.3			3.8		
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP									
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	793.7			1 000.7			1 346.7		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6.75 / 6.75 / 6.75			6.75 / 6.75 / 6.75			6.75 / 6.75 / 6.75		
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	270.5			194.0			135.5		
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5.50 / 5.50 / 5.50			5.50 / 5.50 / 5.50			5.50 / 5.50 / 5.50		
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$)	**Dic.29 2023**			**Ene.03 2024**			**Ene.04 2024**		
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	28,1			-50,6			63,9		
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-114,5			-100,1			-7,0		
a. Mercado spot con el público	-5,8			-58,5			33,1		
i. Compras	520,3			655,0			631,0		
ii. (-) Ventas	526,1			713,5			597,9		
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-12,3			-37,4			13,8		
i. Pactadas	218,4			230,0			426,3		
ii. (-) Vencidas	230,7			267,4			412,5		
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-114,5			107,8			-56,9		
i. Pactadas	279,0			660,3			1170,5		
ii. (-) Vencidas	393,5			552,5			1227,4		
d. Operaciones cambiarias interbancarias									
i. Al contado	511,3			367,7			464,1		
ii. A futuro	189,0			162,0			90,0		
e. Operaciones socl asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	134,9			259,9			788,5		
i. Compras	364,2			511,6			1190,3		
ii. (-) Ventas	229,3			251,7			401,7		
f. Efecto de Opciones	0,5			-0,4			0,2		
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-40,9			168,7			-13,8		
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera									
Tasa de interés									
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,7111			3,7336			3,7407		

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera