# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

## RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

| | 08 Ene 24 | 09 Ene 24 | 10 Ene 24 | 11 Ene 24 | 12 Ene 24 |
|---|---|---|---|---|---|
| **1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP** | **11 143,1** | **11 381,9** | **12 139,8** | **11 761,9** | **10 699,4** |
| **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) | | | 500.0 | 500.0 | 300.0 |
| Procesuales recibidas | | | 1805.0 | 1880.0 | 1050.0 |
| Plazo de vencimiento | | | 182 d | 181 d | 180 d |
| Tasas de interés: Mínima | | | 6.80 | 6.78 | 6.80 |
| Máxima | | | 6.84 | 6.79 | 6.79 |
| Promedio | | | 6.78 | 6.78 | 6.79 |
| Saldo | 14 996.0 | 14 996.0 | 14 570.0 | 14 896.0 | 14 174.0 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Enero del 2024 | 200.0 | 200.0 | 1 775.0 | 1 775.0 | 1 775.0 |
| Vencimiento de CD BCRP del 15 al 19 de enero de 2024 | 200.0 | 200.0 | | | 1 775.0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | 1000.0 | | | | 300.0 |
| Procesuales recibidas | 1840.0 | | | | 300.0 |
| Plazo de vencimiento | 1 d | | | | 91 d |
| Tasas de interés: Mínima | 6.76 | | | | 6.35 |
| Máxima | 6.84 | | | | 6.41 |
| Promedio | 6.79 | | | | 6.39 |
| Saldo | 11 332.1 | 10 332.1 | 10 332.1 | 9 832.1 | 9 532.2 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 17 de Enero del 2024 | 1 000.0 | 500.0 | 500.0 | 599.9 | 0.6 |
| Vencimiento de Repo Valores del 15 al 19 de enero de 2024 | 2 099.9 | 1 099.9 | 1 099.9 | 599.9 | 500.6 |
| iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General) | | | | | |
| Procesuales 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 15 al 19 de enero de 2024 | | | | | |
| iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo) | | | | | |
| Procesuales recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 6 257.5 | 6 257.5 | 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 | 1.5 | 1.5 |
| Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 15 al 19 de enero de 2024 | | | | | 0.0 |
| v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular) | | | | | |
| Garantía para los créditos | | | | | |
| Procesuales 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 | | | | | |
| Procesuales 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) | | | | | |
| Procesuales recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR | | | | | |
| Vencimiento de Repo Especial - CDR del 15 al 19 de enero de 2024 | | | | | |
| viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acceso de Liquidez | | | | | |
| Procesuales 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 15 al 19 de enero de 2024 | | | | | |
| ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP) | | | | | |
| Procesuales recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Márgen: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de CDV BCRP | | | | | |
| Vencimientos de CDV BCRP del 15 al 19 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 15 al 19 de enero de 2024 | | | | | |
| xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP) | | | 1 988.2 | 1 500.1 2 000.0 | 2 000.0 2 500.0 |
| Procesuales recibidas | | | 1 988.2 | 2 504.0 2 370.4 | 3 145.0 3 150.4 |
| Plazo de vencimiento | | | 1 d | 1 d 1 d | 3 d 3 d |
| Tasas de interés: Mínima | | | 5.95 | 6.15 6.10 | 6.10 6.10 |
| Máxima | | | 6.75 | 6.72 6.75 | 6.47 6.40 |
| Promedio | | | 6.39 | 6.56 6.62 | 6.42 6.35 |
| Saldo | | | 1 988.2 | 3 500.1 | 4 500.0 |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 15 de Enero del 2024 | | | 1 988.2 | 3 500.1 | 4 500.0 |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo del 15 al 19 de enero de 2024 | | | 1 988.2 | 3 500.1 | 4 500.0 |
| xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP) | 300.0 | | | 300.0 | 251.0 |
| Procesuales recibidas | 823.0 | | | 813.9 | 1032.0 |
| Plazo de vencimiento | 31 d | | | 32 d | 33 d |
| Tasas de interés: Mínima | 6.75 | | | 6.57 | 6.57 |
| Máxima | 6.80 | | | 6.80 | 6.65 |
| Promedio | 6.85 | | | 6.75 | 6.65 |
| Saldo | 5 232.3 | 5 232.3 | 5 232.3 | 5 282.3 | 5 233.3 |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 15 de Enero del 2024 | 250.0 | 250.0 | 250.0 | 300.0 | 299.9 |
| Vencimiento de Coloc-TP del 15 al 19 de enero de 2024 | 550.0 | 550.0 | 550.0 | 300.0 | 1 138.9 |
| xiii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación | | | | | |
| Procesuales recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de Coloc-BN | | | | | |
| Vencimiento de Coloc - BN del 15 al 19 de enero de 2024 | | | | | |
| xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP) | | | | | Desierta |
| Procesuales recibidas | | | | | - - |
| Plazo de vencimiento | | | | | 60 d |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 530.0 | 530.0 | 530.0 | 530.0 | 230.0 |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP el 26 de Febrero del 2024 | 300.0 | 300.0 | 300.0 | 300.0 | 10.0 |
| Vencimiento de CDR BCRP del 15 al 19 de enero de 2024 | 300.0 | 300.0 | 300.0 | 300.0 | 0.0 |
| xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR) | | | | | |
| Procesuales recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de CDBCRP-NR | | | | | |
| Vencimientos de CD BCRP del 15 al 19 de enero de 2024 | | | | | |
| xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular) | | | | | |
| Procesuales recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 227.0 | 207.0 | 207.0 | 207.0 | 207.0 |
| Próximo vencimiento de Repo Regular el 18 de Enero del 2024 | 20.0 | 20.0 | 20.0 | 20.0 | 20.0 |
| Vencimiento de REPO del 15 al 19 de enero de 2024 | 20.0 | | | | 20.0 |
| xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa | | | | | |
| Procesuales recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de Repo | | | | | |
| Vencimiento de REPO del 15 al 19 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 Repo Expansión | | | | | |
| Vencimiento de REPO Expansión del 15 al 19 de enero de 2024 | | | | | |
| xix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución) | | | | | |
| Procesuales recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de Repo Sustitución | | | | | |
| Vencimiento de REPO Sustitución del 15 al 19 de enero de 2024 | | | | | |
| xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | | | | 200.0 Desierta 200.0 | Desierta 300.0 137.0 300.1 |
| Procesuales recibidas | | | | 460.0 - 260.0 | 963.0 799.0 488.0 |
| Plazo de vencimiento | | | | 91 d 273 d 91 d | 95 d 95 d 367 d 367 d |
| Tasas de interés: Mínima | | | | 6.95 - 6.95 | 0.00 5.17 4.94 5.07 |
| Máxima | | | | 6.90 - 6.44 | 0.00 5.95 5.10 5.10 |
| Promedio | | | | 6.45 - 6.55 | 0.00 5.95 5.10 5.08 |
| Saldo | 45 975.8 | 45 975.8 | 45 975.8 | 45 975.8 | 44 012.9 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 17 de Enero del 2024 | 400.0 | 400.0 | 400.0 | 175.0 | 175.0 |
| Vencimiento de SC - Venta del 15 al 19 de enero de 2024 | 400.0 | 400.0 | 400.0 | | 230.0 |
| xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED) | | | | | |
| Procesuales recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de RED | | | | | |
| Vencimiento de RED del 15 al 19 de enero de 2024 | | | | | |
| xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés | | | | | |
| Procesuales 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 15 al 19 de enero de 2024 | | | | | |
| b. Usual: Repos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP ) | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| 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 | 0.3 | 0.0 | 0.9 | 7.3 |
| d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$) | 0.0 | 0.3 | 0.0 | 0.9 | 7.3 |
| i. Compras (millones de US$) | 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 |
| 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** | **12 443.1** | **11 381.9** | **10 199.8** | **8 797.5** | **7 053.8** |
| **4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones** | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). | | | | | |
| (Contratos Repo abiertos diarios) | 0.0000% | 0.0000% | 0.0000% | 0.0000% | 0.0000% |
| b. Compra temporal directa de valores (Repo de subasta) | 0.0 | 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 | 247.0 | 316.0 | 63.0 | 792.0 | 46.0 |
| Tasa de interés | 4.00% | 4.00% | 4.00% | 4.00% | 3.75% |
| **5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones** | **12 196.1** | **11 065.9** | **10 136.8** | **7 995.5** | **7 007.8** |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*) | 16 788.5 | 17 039.5 | 17 049.8 | 16 982.3 | 16 846.6 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*) | 8.0 | 8.1 | 8.1 | 8.0 | 7.9 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 9 701.2 | 9 951.4 | 9 949.9 | 9 882.4 | 9 546.7 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*) | 4.6 | 4.7 | 4.7 | 4.7 | 4.5 |
| **6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP** | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 1 308.0 | 1 663.7 | 1 408.7 | 807.7 | 942.6 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO | 6.75 / 6.75 / 6.75 | 6.75 / 6.75 / 6.75 | 6.75 / 6.75 / 6.75 | 6.75 / 6.75 / 6.75 | 6.50 / 6.50 / 6.50 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$) | 169.7 | 259.0 | 271.0 | 171.0 | 149.0 |
| 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$)** | **Ene.05 2024** | **Ene.08 2024** | **Ene.09 2024** | **Ene.10 2024** | **Ene.11 2024** |
| Plazo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g | 153,5 | -62,7 | -33,4 | -63,1 | 8,5 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g | 329,8 | 0,7 | 46,6 | -32,1 | 24,0 |
| a. Mercado spot con el público | 342,0 | 1,8 | 52,7 | -17,6 | 33,9 |
| i. Compras | 932,7 | 874,6 | 453,6 | 378,7 | 660,7 |
| ii. (-) Ventas | 590,7 | 873,0 | 400,9 | 396,4 | 626,8 |
| b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega) | 92,9 | 59,5 | -78,3 | 9,4 | 65,8 |
| i. Pactadas | 135,9 | 262,4 | 244,6 | 168,6 | 380,9 |
| ii. (-) Vencidas | 43,0 | 202,9 | 322,9 | 159,2 | 315,3 |
| c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega) | 260,4 | 122,7 | 1,5 | 40,0 | 82,7 |
| i. Pactadas | 347,9 | 403,7 | 389,9 | 454,8 | 595,2 |
| ii. (-) Vencidas | 87,5 | 280,9 | 388,4 | 414,8 | 512,6 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 496,1 | 793,9 | 659,0 | 533,2 | 438,0 |
| ii. A futuro | 46,0 | 80,0 | 98,0 | 110,0 | 32,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entregas | 38,7 | 79,6 | 58,3 | 252,4 | 193,0 |
| i. Compras | 79,6 | 280,1 | 375,3 | 409,5 | 507,9 |
| ii. (-) Ventas | 40,9 | 200,5 | 317,0 | 157,1 | 314,8 |
| f. Efecto de Opciones | -8,8 | -0,3 | -0,3 | -0,4 | -1,0 |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -6,3 | -2,4 | 1,1 | -11,2 | -3,2 |
| h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,7154 | 3,7133 | 3,7060 | 3,7002 | 3,6995 |

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera