BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	22 Ene 24		23 Ene 24		24 Ene 24		25 Ene 24		26 Ene 24	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**9 205,8**		**8 766,8**		**7 629,4**		**7 954,3**		**7 517,1**	
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		200.0				300.0			
Plazo de vencimiento	410.0		325.0				590.0			
Tasas de interés: Mínima	183.d		183.d				181.d			
Máxima	5.45		5.45				5.46			
Promedio	5.45		5.45				5.46			
Saldo	17 467.4		17 467.4		17 467.4		16 908.5		16 908.5	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Febrero del 2024	1 050.0		1 050.0		1 050.0		1 100.0		1 100.0	
Vencimiento de CD BCRP del 29 de enero al 02 de febrero de 2024	1 050.0		1 050.0		1 050.0					
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)									300.0	
Propuestas recibidas									460.0	
Plazo de vencimiento									91.d	
Tasas de interés: Mínima									6.30	
Máxima									6.32	
Promedio									6.31	
Saldo	9 411.5		9 411.5		9 411.5		9 411.5		9 111.5	
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 29 de Enero del 2024	600.0		600.0		600.0		600.0		400.0	
Vencimiento de Reco Valores del 29 de enero al 02 de febrero de 2024	600.0		600.0		600.0		600.0		1 650.0	
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 Reco de Cartera General										
Vencimiento de Reco de Cartera General del 29 de enero al 02 de febrero de 2024										
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	6 256.0		6 256.0		6 256.0		6 256.0		6 256.0	
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 26 de Febrero del 2024	8.3		8.3		8.3		8.3		8.3	
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 29 de enero al 02 de febrero 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		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 Reco Especial - CDR del 29 de enero al 02 de febrero 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 Reco de Cartera para el Apoyo de Liquidez										
Vencimientos de Reco de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 29 de enero al 02 de febrero de 2024										
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Mínimo: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de CDV BCRP										
Vencimientos de CDV BCRP del 29 de enero al 02 de febrero 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 29 de enero al 02 de febrero de 2024										
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 000.0 3 056.1		3 000.1 4 302.8		3 000.1 4 302.8		2 999.8 2 818.1		2 000.0 3 784.4	
Propuestas recibidas	3 583.6 3 056.1		3 778.6 4 302.8		3 778.6 4 302.8		3 862.6 2 818.1		3 140.1 3 784.4	
Plazo de vencimiento	1.d 1.d		1.d 1.d		1.d 1.d		1.d 1.d		3.d 3.d	
Tasas de interés: Mínima	6.40 6.40		6.40 6.40		6.40 6.40		6.40 6.42		6.40 6.40	
Máxima	6.50 6.50		6.50 6.50		6.50 6.50		6.50 6.50		6.50 6.50	
Promedio	6.48 6.48		6.48 6.47		6.48 6.47		6.49 6.49		6.47 6.49	
Saldo	6 056.1		7 302.9		7 302.9		5 817.9		5 784.4	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 29 de Enero del 2024	6 056.1		7 302.9		7 302.9		5 817.9		5 784.4	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 29 de enero al 02 de febrero de 2024	6 056.1		7 302.9		13 282.8		5 817.9		5 784.4	
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0		300.1		300.1		300.0			
Propuestas recibidas	773.9		753.0		753.0		469.7			
Plazo de vencimiento	35.d		35.d		35.d		35.d			
Tasas de interés: Mínima	6.63		6.63		6.63		6.63			
Máxima	6.64		6.64		6.64		6.66			
Promedio	6.63		6.63		6.63		6.63			
Saldo	5 447.5		5 677.6		5 677.6		5 777.5		5 777.5	
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 31 de Enero del 2024	70.0		300.1		300.1		300.1		300.1	
Vencimiento de Coloc-TP del 29 de enero al 02 de febrero de 2024	570.1		500.1		500.1				300.1	
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 29 de enero al 02 de febrero 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	230.0		230.0		230.0		230.0		230.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 26 de Febrero del 2024	10.0		10.0		10.0		10.0		10.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 29 de enero al 02 de febrero de 2024										
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Mantenimiento Reajustable (CDR BCRP-NR)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR										
Vencimientos de CD BCRP del 29 de enero al 02 de febrero de 2024										
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	187.0		187.0		187.0		187.0		187.0	
Próximo vencimiento de Reco Regular el 5 de Febrero del 2024	20.0		20.0		20.0		20.0		20.0	
Vencimiento de REPO del 29 de enero al 02 de febrero 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 Reco										
Vencimiento de RPD del 29 de enero al 02 de febrero 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 29 de enero al 02 de febrero 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 29 de enero al 02 de febrero de 2024										
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		200.1 200.0		200.1 200.0		200.0 187.0 200.0		200.0 140.0 300.0 400.0 500.0 500.0		
Propuestas recibidas		884.5 1012.0		884.5 1012.0		490.0 462.0 664.0		458.0 295.0 1059.0 1729.0 670.0 670.0		
Plazo de vencimiento		91.d 366.d		91.d 366.d		91.d 365.d 365.d		273.d 367.d 97.d 97.d 367.d 367.d		
Tasas de interés: Mínima		4.88 4.46		4.88 4.46		5.16 5.16 4.97		5.18 5.15 5.45 4.98 4.71 4.71		
Máxima		5.04 4.49		5.04 4.49		5.44 5.16 4.97		5.19 5.15 5.45 4.99 5.15 5.15		
Promedio		4.99 4.49		4.99 4.49		5.40 5.08 4.97		5.21 5.15 5.45 4.98 5.01 5.01		
Saldo	47 590.9	47 590.9	47 590.9	47 590.9		47 866.9	48 166.9			
Próximo vencimiento de SC-Venta el 29 de Enero del 2024	500.0	500.0	500.0			580.0		300.1		
Vencimiento de SC - Venta del 29 de enero al 02 de febrero de 2024	1 580.0	1 580.0	1 580.0			580.0		1 720.1		
xxi. Subasta de Reco 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 29 de enero al 02 de febrero 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 29 de enero al 02 de febrero 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			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	0.0	0.0			0.0		0.0		
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.9	1.7	3.1			0.8		1.5		
i. Compras (millones de US$)	0.9	1.7	3.1			0.8		1.5		
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0			0.0		0.0		
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0			0.0		0.0		
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP (Valorizado)										
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 473.5**	**2 856.6**	**3 192.4**			**3 492.0**		**3 512.7**		
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).										
(Contratos Tipo efectivo diario)	0.00%	0.00%	0.00%			0.00%		0.00%		
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0			0.0		0.0		
Tasa de interés										
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	901.0	941.0	489.0			836.0		1 345.0		
Tasa de interés	3.75%	3.75%	3.75%			3.75%		3.75%		
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3 572.5**	**1 915.6**	**2 703.4**			**2 656.0**		**2 167.7**		
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	14 555.1	14 372.9	14 082.5			13 944.6		13 783.3		
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	6.9	6.8	6.6			6.6		6.5		
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 411.1	7 226.9	6 938.5			6 800.6		6 639.4		
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	3.5	3.4	3.3			3.2		3.1		
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	954.0	877.0	657.0			714.0		553.0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6.50 / 6.50 / 6.50	6.50 / 6.50 / 6.50	6.50 / 6.50 / 6.50			6.50 / 6.50 / 6.50		6.50 / 6.50 / 6.50		
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	179.8	252.5	261.3			182.0		189.0		
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.19 2024**	**Ene.22 2024**	**Ene.23 2024**			**Ene.24 2024**		**Ene.25 2024**		
Plazo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f.i + g	-53.3	61.8	-43.0			-192.5		9.3		
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	44,5	122,0	-26,3			-137,2		-18,5		
a. Mercado spot con el público	68.0	217.5	-19.0			-131.6		-1.8		
i. Compras	490.9	697.4	482.8			335.4		496.1		
ii. (-) Ventas	422.9	480.0	501.8			467.0		497.9		
b. Contratos forward y swap al público (con v sin entrega)	138.6	26.7	168.3			-131.3		148.6		
i. Pactadas	171.3	66.3	233.7			364.1		353.7		
ii. (-) Vencidas	32.7	39.6	65.4			495.4		205.1		
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	232.6	86.9	289.4			-21.2		141.8		
i. Pactadas	270.3	244.0	751.8			1011.0		564.4		
ii. (-) Vencidas	37.6	157.0	462.4			1032.2		422.6		
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	612.4	568.8	529.9			454.9		385.8		
ii. A futuro	40.0	40.0	138.0			10.0		108.0		
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entregas	-5.7	72.2	396.7			533.8		208.9		
i. Compras	24.7	110.6	462.0			1028.7		413.6		
ii. (-) Ventas	30.4	38.4	65.3			494.9		204.7		
f. Efecto de Opciones	-3.9	0.0	-2.3			-2.3		-0.1		
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-12.8	-50.2	99.8			54.4		13.0		
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7399	3.7394	3.7536			3.7581		3.7620		

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera