BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	04 Mar 24	05 Mar 24	06 Mar 24	07 Mar 24	08 Mar 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 877.8**	**9 899.9**	**10 167.9**	**10 721.2**	**9 717.8**
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)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	97 154.6	97 154.6	97 154.6	97 154.6	97 154.6
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Marzo del 2024	1 652.7	1 652.7	1 652.7	1 652.7	1 652.7
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 15 de marzo de 2024	0.0				3 052.7
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1000.0 1500.0	1000.0 700.0	700.0		300.0
Procuestas recibidas	1700.0 1850.0	1800.1 1380.0	1520.0		520.0
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d		90 d
Tasas de interés: Mínima	6.25 6.25	6.25 6.25	6.30		6.10
Máxima	6.28 6.27	6.30 6.27	6.30		6.15
Promedio	6.27 6.26	6.26 6.26	6.30		6.12
Saldo	10 186.5	9 386.5	8 386.5	7 686.5	7 986.5
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 15 de Marzo del 2024	2 500.0	1 700.0	700.0	300.0	300.0
Vencimiento de Reco Valores del 11 al 15 de marzo de 2024	2 500.0	1 700.0	700.0		300.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Procuestas 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 11 al 15 de marzo de 2024					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 241.6	6 241.6	6 241.6	6 241.6	6 241.6
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 20 de Marzo del 2024	4.2	4.2	4.2	4.2	4.2
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 11 al 15 de marzo de 2024	0.0				
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Reactiva)					
Garantía para los créditos					
Procuestas 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 (Esacial)					
Garantía para los créditos					
Procuestas 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 (RREP) Especial - CDR					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Esacial - CDR					
Vencimiento de Reco Esacial - CDR del 11 al 15 de marzo de 2024					
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Apoyo de Liquidez					
Procuestas 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 11 al 15 de marzo de 2024					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 11 al 15 de marzo de 2024					
x. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Procuestas 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 marzo de 2024					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)				500.0	900.0
Procuestas recibidas				2 763.1	1 761.1
Plazo de vencimiento				1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima				4.51	5.00
Máxima				5.99	5.99
Promedio				5.56	5.49
Saldo				500.0	900.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 11 de Marzo del 2024				500.0	900.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 11 al 15 de marzo de 2024				500.0	900.0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	270.0	28.6	250.0	130.0	Desierta
Procuestas recibidas	454.6	338.6	350.0	370.0	
Plazo de vencimiento	31 d	31 d	33 d	33 d	33 d
Tasas de interés: Mínima	6.13	6.14	6.05	6.05	
Máxima	6.30	6.14	6.15	6.05	
Promedio	6.16	6.14	6.13	6.05	
Saldo	3 514.4	3 243.0	3 293.0	3 064.1	2 764.1
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 14 de Marzo del 2024	300.0	200.0	358.9	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 11 al 15 de marzo de 2024	1 158.9	858.9	658.9	300.0	600.0
xiii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Procuestas 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 marzo de 2024					
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	65.0	65.0	65.0	65.0	65.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 8 de Mayo del 2024	65.0	65.0	65.0	65.0	65.0
Vencimiento de CDR BCRP del 11 al 15 de marzo de 2024	0.0				
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Remuneración Restringida (CDR BCRP-NR)					
Procuestas 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 marzo de 2024					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	145.0	145.0	145.0	145.0	145.0
Próximo vencimiento de Reco Regular el 14 de Marzo del 2024	25.0	25.0	25.0	25.0	25.0
Vencimiento de REPO del 11 al 15 de marzo de 2024	0.0				25.0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco					
Vencimiento de RREP del 11 al 15 de marzo de 2024					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Excepción)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Excepcion					
Vencimiento de REPO Excepción del 11 al 15 de marzo de 2024					
xix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 11 al 15 de marzo de 2024					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				300.0	
Procuestas recibidas				526.0	
Plazo de vencimiento				95 d	
Tasas de interés: Mínima				6.70	
Máxima				6.95	
Promedio				6.91	
Saldo	68 005.9	68 005.9	68 005.9	68 805.9	68 805.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de Marzo del 2024	670.0	670.0	35.0	35.0	35.0
Vencimiento de SC - Venta del 11 al 15 de marzo de 2024	670.0	670.0			495.0
xxi. Subasta de Reco de Valores sara orowser dólares (RED)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 11 al 15 de marzo de 2024					
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés					
Procuestas 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 marzo de 2024					
b. Usual. Reros 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	-7.5	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	2.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	3.8	0.0	0.0	0.0	0.0
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.5	0.5	0.4	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.5	0.5	0.4	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP. CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**11 640.3**	**11 627.5**	**11 117.9**	**10 491.2**	**9 702.8**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	0.0179%	0.0179%	0.0179%	0.0179%	0.0184%
(Tasa efectiva diaria)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Compra temporal diaria de valores (tasa de subasta)					
Tasa de interés					
c. Crédito por reputación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	391.0	538.0	517.0	531.0	1 191.0
Tasa de interés	3.75%	3.75%	3.75%	3.75%	3.75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**11 249.3**	**11 089.5**	**10 600.9**	**9 930.2**	**8 511.8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	18 207.5	18 193.3	18 136.4	18 136.4	17 751.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8.7	8.7	8.6	8.6	8.5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	11 284.9	11 270.7	11 213.8	11 213.8	10 831.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.4	5.4	5.3	5.3	5.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	786.7	948.7	979.7	1 479.7	1 293.7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6.25 / 6.25 / 6.25	6.25 / 6.25 / 6.25	6.25 / 6.25 / 6.25	6.25 / 6.25 / 6.25	6.25 / 6.25 / 6.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	201.5	189.0	210.5	266.0	112.0
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$)	**Mar.01 2024**	**Mar.04 2024**	**Mar.05 2024**	**Mar.06 2024**	**Mar.07 2024**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e.1 + g	37.3	132.0	45.5	-86.7	217.7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-71.0	-89.2	-14.7	-21.2	-48.9
a. Mercado spot con el público	-37.9	-80.8	9.2	-14.4	44.8
i. Compras	439.5	357.6	453.0	475.5	517.1
ii. (-) Ventas	477.4	448.4	443.8	489.9	472.4
b. Compras forward y swap al público (con v sin entrega)	73.1	204.0	119.6	-35.7	25.5
i. Pactadas	271.6	414.0	445.8	335.3	343.1
ii. (-) Vencidas	198.6	210.0	326.2	371.0	317.6
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-49.6	61.3	187.1	45.6	-158.0
i. Pactadas	215.9	364.8	641.2	1239.3	411.0
ii. (-) Vencidas	265.4	303.5	454.2	1193.7	569.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	676.0	421.3	473.3	606.4	586.6
ii. A futuro	92.0	130.0	40.0	25.0	5.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entregs	35.4	91.2	116.6	820.6	187.5
i. Compras	232.8	300.3	442.2	1190.2	490.1
ii. (-) Ventas	197.4	209.0	325.5	369.6	302.6
f. Efecto de Opciones	1.5	0.7	-5.1	7.5	2.4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-17.5	81.7	120.1	1.6	51.0
h. Crédito por reputación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7695	3.7645	3.7687	3.7268	3.7205
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera