BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	01 Abr 24	02 Abr 24	03 Abr 24	04 Abr 24	05 Abr 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**10 352,2**	**10 671,0**	**11 303,5**	**11 738,6**	**9 569,5**
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)					
Procesuales recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	23 993.4	23 993.4	23 993.4	23 993.4	23 993.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de Abril del 2024	1 800.0	1 800.0	1 800.0	1 800.0	1 800.0
Vencimiento de CD BCRP del 08 al 12 de abril de 2024	0.0				
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1500.0 600.0	700.0			300.0
Procesuales recibidas	1720.0 880.0	1625.0			550.0
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d			31 d
Tasas de interés: Mínima	6.25 6.28	6.28			6.25
Máxima	6.28 6.28	6.28			6.28
Promedio	6.26 6.28	6.28			6.27
Saldo	10 386.5	8 986.5	8 286.5	8 286.5	7 686.5
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 12 de Abril del 2024	2 100.0	700.0	900.0	900.0	300.0
Vencimiento de Reco Valores del 08 al 12 de abril de 2024	3 000.0	1 600.0	900.0	900.0	300.0
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 Reco de Cartera General					
Vencimiento de Reco de Cartera General del 08 al 12 de abril de 2024					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procesuales recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 237.4	6 237.4	6 237.4	6 237.4	6 237.4
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 22 de Abril del 2024	1.7	1.7	1.7	1.7	1.7
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 08 al 12 de abril de 2024					
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Recular)					
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 (Excecial)					
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 (RREPO Especial - CDR)					
Procesuales recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR					
Vencimiento de Reco Especial - CDR del 08 al 12 de abril de 2024					
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para al Apoyo de Liquidez					
Procesuales 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 08 al 12 de abril de 2024					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Procesuales recibidas					
Plazo de vencimiento					
Mínimo: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 08 al 12 de abril de 2024					
x. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Procesuales recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP					
Vencimiento de CDLD BCRP del 08 al 12 de abril de 2024					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)				2 199.9	1 500.0 2 399.9
Procesuales recibidas				3 100.7	2 949.0 3 930.7
Plazo de vencimiento				1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima				5.60	5.90 5.95
Máxima				6.19	6.17 6.14
Promedio				6.05	6.11 6.10
Saldo				2 199.9	3 899.9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 8 de Abril del 2024				2 199.9	3 899.9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 08 al 12 de abril de 2024				2 199.9	3 899.9
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0	300.0			
Procesuales recibidas	565.0	486.0			
Plazo de vencimiento	31 d	31 d			
Tasas de interés: Mínima	6.98	6.98			
Máxima	6.98	6.98			
Promedio	6.98	6.98			
Saldo	2 164.1	2 192.8	2 192.8	1 922.8	1 894.2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 8 de Abril del 2024	271.3	270.0	270.0	28.6	250.0
Vencimiento de Coloc-TP del 08 al 12 de abril de 2024	569.9	298.6	298.6	28.6	394.2
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 08 al 12 de abril de 2024					
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Procesuales 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 08 al 12 de abril de 2024					
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Mantenimiento Reajustable (CDR BCRP-NR)					
Procesuales recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 08 al 12 de abril de 2024					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Recular)					
Procesuales recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	70.0	70.0	70.0	70.0	50.0
Próximo vencimiento de Reco Recular el 8 de Mayo del 2024	20.0	20.0	20.0	20.0	25.0
Vencimiento de REPO del 08 al 12 de abril de 2024	20.0	20.0	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 Reco					
Vencimiento de RREPO del 08 al 12 de abril de 2024					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Procesuales recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 08 al 12 de abril 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 Reco Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 08 al 12 de abril de 2024					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300.0		300.0	200.0 300.0	300.0
Procesuales recibidas	1435.0		1073.0	645.0 1055.0	897.0
Plazo de vencimiento	91 d		91 d	90 d 92 d	91 d
Tasas de interés: Mínima	6.10		6.46	6.54 6.57	6.48
Máxima	6.40		6.46	6.55 6.57	6.57
Promedio	6.40		6.46	6.55 6.57	6.52
Saldo	57 604.6		57 164.6	56 904.6	56 704.6
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de Abril del 2024	700,1	700,1	700,0	500,0	505,0
Vencimiento de SC - Venta del 08 al 12 de abril de 2024	1 900,1	1 900,1	1 200,0	500,0	2 005,0
xxi. Subasta de Reco 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 08 al 12 de abril 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 08 al 12 de abril de 2024					
b. Usual: Reros 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	1.6	0.9	0.4	0.1	0.1
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	1.6	0.9	0.4	0.1	0.1
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**12 742,2**	**11 655,0**	**11 303,5**	**10 322,6**	**8 729,7**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
(Montos fuera efectivo diario)	0.0 0.0%	0.0 0.0%	0.0 0.0%	0.0 0.0%	0.0 0.0%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0.0	0.0	518.0	76.0	785.0
Tasa de interés	3.75%	3.75%	3.75%	3.75%	3.75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**12 742,2**	**11 655,0**	**10 785,5**	**10 246,6**	**8 944,7**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13 227.8	19 979.8	19 263.8	18 737.1	18 387.9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	6.3	9.4	9.1	8.9	8.7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 908.0	12 742.2	12 017.4	11 492.0	11 135.2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	3.0	6.0	5.7	5.5	5.3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	841.7	947.7	1 166.3	1 027.2	1 390.2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6.25 / 6.25 / 6.25	6.25 / 6.25 / 6.25	6.25 / 6.25 / 6.25	6.25 / 6.25 / 6.25	6.25 / 6.25 / 6.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	35.0	40.0	40.0	70.0	60.0
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.27 2024**	**Abr.01 2024**	**Abr.02 2024**	**Abr.03 2024**	**Abr.04 2024**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f.i + g	-21.8	51.8	22.8	-5.5	-42.3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	518.3	84.2	-105.7	-39.1	-86.0
a. Mercado spot con el público	598.6	84.6	-75.8	12.8	62.8
i. Compras	1385.6	738.4	493.3	715.2	622.7
ii. (-) Ventas	829.0	653.8	569.0	702.3	559.9
b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega)	3.4	68.5	92.5	152.4	-290.9
i. Pactadas	160.2	122.8	249.6	409.9	171.6
ii. (-) Vencidas	156.8	54.2	157.1	257.5	462.6
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	513.3	125.2	-28.3	18.7	-382.6
i. Pactadas	1011.4	435.0	388.3	517.7	431.4
ii. (-) Vencidas	498.1	309.8	416.6	499.0	814.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	753.4	286.8	468.1	654.9	436.9
ii. A futuro	245.0	167.0	30.0	79.0	15.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entregas	305.1	259.7	236.7	229.8	271.1
i. Compras	454.9	297.3	387.1	476.6	729.6
ii. (-) Ventas	149.8	37.6	156.3	246.8	458.5
f. Efecto de Opciones	2.5	-2.5	7.6	7.4	1.5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-34.8	22.0	-1.2	-147.8	-117.9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7127	3.7301	3.7062	3.6872	3.6735

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera