BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	29 Abr 24	30 Abr 24	02 May 24	03 May 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**7 987,54**	**8 112,0**	**9 042,6**	**8 769,36**
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	10 497,9	10 497,9	10 497,9	10 347,9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Mayo del 2024	450,0	450,0	450,0	1 806,4
Vencimiento de CD BCRP del 6 al 10 de mayo de 2024	450,0	450,0	450,0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)		300,0	2000,0 300,0 1770,0	1500,1 300,0 1100,0
Propuestas recibidas		386,0	2390,0 540,0 1770,0	3000,0 490,0 1400,0
Plazo de vencimiento		7 d	1 d 32 d 1 d	3 d 91 d 3 d
Tasas de interés: Mínima		6,0	6,01 6,29 6,0	6,03 6,03 6,05
Máxima		6,02	6,05 6,31 6,05	6,04 6,05 6,07
Promedio		6,01	6,03 6,30 6,04	6,03 6,04 6,06
Saldo	8 806,5	9 196,5	13 176,5	11 806,6
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 6 de Mayo del 2024	500,0	4 270,0	4 270,0	2 930,1
Vencimiento de Repo Valores del 6 al 10 de mayo de 2024	500,0	4 270,0	4 270,0	3 200,1
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 6 al 10 de mayo de 2024				
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	6 207,2	6 207,2	6 207,2	6 207,2
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 11 de Julio del 2024	2,5	2,5	2,5	2,5
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 6 al 10 de mayo 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
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
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 6 al 10 de mayo 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 6 al 10 de mayo 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 6 al 10 de mayo 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 6 al 10 de mayo de 2024				
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 500,0 3 983,8	3 500,0 2 490,9		
Propuestas recibidas	4 981,6 3 983,8	5 567,6 2 490,9		
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	2 d 2 d		
Tasas de interés: Mínima	5,81 5,83	5,81 5,81		
Máxima	5,96 6,00	5,95 6,00		
Promedio	5,91 5,98	5,92 5,93		
Saldo	7 463,8	5 990,9		
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	7 463,8	5 990,9		
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 6 al 10 de mayo de 2024	7 463,8	5 990,9		
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300,0		300,0	300,0
Propuestas recibidas	1024,0		915,0	949,0
Plazo de vencimiento	32 d		33 d	34 d
Tasas de interés: Mínima	6,93		6,90	6,95
Máxima	6,96		6,97	6,98
Promedio	6,95		6,93	6,96
Saldo	2 400,0	2 400,0	2 400,0	2 400,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 8 de Mayo del 2024	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 6 al 10 de mayo de 2024	600,0	600,0	300,0	900,0
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 6 al 10 de mayo 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	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
Vencimiento de CDR BCRP del 6 al 10 de mayo de 2024				65,0
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Rendimiento Registrado (CDBCRP-NR)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR				
Vencimientos de CD BCRP del 6 al 10 de mayo de 2024				
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	50,0	50,0	50,0	50,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 8 de Mayo del 2024	25,0	25,0	25,0	25,0
Vencimiento de REPO del 6 al 10 de mayo de 2024				25,0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo				
Vencimiento de REPO del 6 al 10 de mayo 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 Expansion				
Vencimiento de REPO Expansión del 6 al 10 de mayo 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 Repo Sustitución				
Vencimiento de REPO Sustitución del 6 al 10 de mayo de 2024				
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			300,0 Desierta	250,0
Propuestas recibidas			485,0 - -	250,0
Plazo de vencimiento			92 d 182 d	94 d
Tasas de interés: Mínima			6,69 -	6,68
Máxima			6,90 -	6,68
Promedio			6,77 -	6,68
Saldo	67 365,7	67 365,7	67 165,7	68 215,7
Próximo vencimiento de SC-Venta el 6 de Mayo del 2024	900,0	900,0	700,0	700,0
Vencimiento de SC - Venta del 6 al 10 de mayo de 2024	1 600,0	1 600,0	700,0	2 530,0
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 6 al 10 de mayo 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 6 al 10 de mayo 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
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0	0,0	0,0	0,0
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0,2	16,0	0,3	3,8
i. Compras (millones de US$)	0,2	16,0	0,3	3,8
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	3,9	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP (Valorizado)	3,9			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 917,3**	**4 544,0**	**13 412,6**	**11 969,5**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
(Contratos Tasa efectiva diaria)	0 (0/360)	0 (0/360)	0 (0/360)	0 (0/360)
b. Compra temporal directa de valores (Repo de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés				
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 703,2	3 088,4	0,0	560,0
Tasa de interés	3,75%	3,75%	3,75%	3,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 214,1**	**1 455,6**	**13 412,6**	**11 409,5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 140,7	11 970,7	11 872,7	16 364,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,7	5,6	5,6	7,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 958,1	4 787,5	4 687,8	9 427,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,3	2,3	2,2	4,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 451,0	611,0	1 902,0	2 484,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6.00 / 6.00 / 6.00	6.00 / 6.05 / 6.00	6.00 / 6.00 / 6.00	6.00 / 6.00 / 6.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	203,0	50,0	93,0	139,0
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
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$)	**Abr.26 2024**	**Abr.29 2024**	**Abr.30 2024**	**May. 2 2024**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + o	3,4	11,0	-35,6	111,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-54,3	-28,5	95,2	1,3
a. Mercado spot con el público	-44,6	-27,4	100,5	49,1
i. Compras	1051,2	650,8	457,4	1032,3
ii. (-) Ventas	1095,8	678,2	356,9	983,3
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	3,0	-191,8	153,0	-173,3
i. Pactadas	646,4	227,6	290,5	282,0
ii. (-) Vencidas	643,4	419,4	137,6	455,3
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-139,6	-224,6	275,0	-447,9
i. Pactadas	633,7	536,3	665,5	489,3
ii. (-) Vencidas	773,2	760,8	390,5	937,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	473,8	514,4	500,3	410,5
ii. A futuro	70,0	0,0	110,0	80,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	122,6	336,8	241,8	435,6
i. Compras	763,7	740,7	375,4	886,5
ii. (-) Ventas	641,1	403,9	133,6	450,9
f. Efecto de Opciones	2,2	6,8	-8,8	-5,9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-89,5	3,5	5,8	-160,3
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,7523	3,7262	3,7533	3,7524
(*) Datos preliminares				

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera