# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

(Millones de Soles)

| | 26 Dic 23 | 27 Dic 23 | 28 Dic 23 | 29 Dic 23 |
|---|---|---|---|---|
| **1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP** | **6 374,3** | **6 633,1** | **6 331,9** | **4 949,2** |
| **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 | 300.0 200.0 | 200.0 | 200.0 | |
| Plazo de vencimiento | 500.0 750.0 | 450.0 | 415.0 | |
| Tasas de interés: Mínima | 181 d 92 d | 180 d | 365 d | |
| Máxima | 5.92 5.93 | 5.90 | 5.41 | |
| Promedio | 5.93 6.34 | 5.92 | 5.42 | |
| | 5.92 6.31 | 5.91 | 5.41 | |
| Saldo | 34 686.0 | 34 886.0 | 35 086.0 | 35 086.0 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP al 3 de Enero del 2024 | 200.0 | 200.0 | 200.0 | 200.0 |
| Vencimiento de CD BCRP al 29 de diciembre de 2023 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 200.0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | | 200.0 | 200.0 | 800.0 300.0 |
| Propuestas recibidas | | 250.0 | 450.0 | 920.0 350.0 |
| Plazo de vencimiento | | 33 d | 32 d | 32 d 98 d |
| Tasas de interés: Mínima | | 6.96 | 7.0 | 7.0 6.65 |
| Máxima | | 7.14 | 7.02 | 7.06 6.73 |
| Promedio | | 6.99 | 7.02 | 7.04 6.68 |
| Saldo | 10 132.1 | 10 332.1 | 10 532.1 | 11 032.1 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores al 29 de Diciembre del 2023 | 600.0 | 600.0 | 600.0 | 500.0 |
| Vencimiento de Repo Valores al 29 de diciembre de 2023 | 600.0 | 600.0 | 600.0 | 1 600.0 |
| 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 Repo de Cartera General | | | | |
| Vencimiento de Repo de Cartera General al 29 de diciembre de 2023 | | | | |
| iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | 6 264.6 | 6 264.6 | 6 264.6 | 6 264.6 |
| Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 3 de Enero del 2024 | 7.1 | 7.1 | 7.1 | 7.1 |
| Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo al 29 de diciembre de 2023 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 7.1 |
| 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 al 29 de diciembre de 2023 | | | | |
| viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acervo de Liquidez | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | | | | |
| Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Acervo de Liquidez | | | | |
| Vencimiento de Repo de Cartera para el Acervo de Liquidez al 29 de diciembre de 2023 | | | | |
| 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 al 29 de diciembre de 2023 | | | | |
| 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 al 29 de diciembre de 2023 | | | | |
| xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP) | 2 000.0 1 732.6 | 2 000.1 3 500.0 | 2 000.0 2 730.6 | 3 200.0 |
| Propuestas recibidas | 2 743.0 1 732.6 | 3 615.0 3 682.4 | 2 610.0 2 732.6 | 3 933.5 |
| Plazo de vencimiento | 1 d 1 d | 1 d 1 d | 1 d 1 d | 5 d |
| Tasas de interés: Mínima | 6.20 5.95 | 6.30 6.25 | 6.45 3.65 | 6.00 |
| Máxima | 6.75 6.75 | 6.75 6.75 | 6.75 6.75 | 6.69 |
| Promedio | 6.61 6.68 | 6.65 6.75 | 6.66 6.70 | 6.46 |
| Saldo | 3 732.6 | 5 500.1 | 4 730.6 | 3 200.0 |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 29 de Diciembre del 2023 | 3 732.6 | 5 500.1 | 4 730.6 | 3 200.0 |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo al 29 de diciembre de 2023 | 3 732.6 | 5 500.1 | 4 730.6 | 3 200.0 |
| xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | 5 744.8 | 5 444.8 | 5 444.8 | 5 144.8 |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 29 de Diciembre del 2023 | 300.0 | 300.0 | 300.0 | 173.0 |
| Vencimiento de Coloc-TP al 29 de diciembre de 2023 | 600.0 | 300.0 | 300.0 | 592.6 |
| 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 al 29 de diciembre de 2023 | | | | |
| xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP) | 10.0 | 220.0 | | |
| Propuestas recibidas | 10.0 | 220.0 | | |
| Plazo de vencimiento | 62 d | 62 d | | |
| Tasas de interés: Mínima | 5.65 | 5.62 | | |
| Máxima | 5.65 | 5.75 | | |
| Promedio | 5.65 | 5.64 | | |
| Saldo | 910.0 | 830.0 | 830.0 | 530.0 |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP al 29 de Diciembre del 2023 | 300.0 | 300.0 | 300.0 | 300.0 |
| Vencimiento de CDR BCRP al 29 de diciembre de 2023 | 600.0 | 300.0 | 300.0 | 0.0 |
| xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | | | | |
| Próximo vencimiento de CDBCRP-NR | | | | |
| Vencimientos de CD BCRP al 29 de diciembre de 2023 | | | | |
| xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | 242.0 | 227.0 | 227.0 | 227.0 |
| Próximo vencimiento de Repo Regular al 5 de Enero del 2024 | 15.0 | 20.0 | 20.0 | 20.0 |
| Vencimiento de REPO al 29 de diciembre de 2023 | 15.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | | | | |
| Próximo vencimiento de Reco | | | | |
| Vencimiento de REPO al 29 de diciembre de 2023 | | | | |
| 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 al 29 de diciembre de 2023 | | | | |
| 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 al 29 de diciembre de 2023 | | | | |
| xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | 10.0 200.0 | Desierta 200.0 100.0 | 100.0 215.0 35.0 | 200.0 160.0 95.0 |
| Propuestas recibidas | 56.0 295.0 | -.- 295.0 240.0 | 420.0 275.0 115.0 | 270.0 200.0 135.0 |
| Plazo de vencimiento | 91 d 366 d | 90 d 366 d 366 d | 183 d 365 d 183 d | 94 d 182 d 367 d |
| Tasas de interés: Mínima | 5.68 5.15 | -.- 5.15 5.27 | 5.50 5.33 5.45 | 5.50 5.42 5.34 |
| Máxima | 5.68 5.25 | -.- 5.30 5.35 | 5.55 5.35 5.45 | 5.54 5.55 5.35 |
| Promedio | 5.68 5.19 | -.- 5.21 5.31 | 5.53 5.34 5.45 | 5.52 5.48 5.35 |
| Saldo | 45 270.8 | 45 370.8 | 45 020.8 | 45 175.8 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 29 de Diciembre del 2023 | 200.0 | 700.0 | 300.0 | 300.0 |
| Vencimiento de SC - Venta al 29 de diciembre de 2023 | 1 200.0 | 1 000.0 | 300.0 | 300.0 |
| 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 al 29 de diciembre de 2023 | | | | |
| 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 al 29 de diciembre de 2023 | | | | |
| b. Liquid. Repos 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 | 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$) | 0.0 | 8.9 | -33.9 | 0.4 |
| i. Compras (millones de US$) | 0.0 | 8.9 | 0.1 | 0.4 |
| ii. Ventas (millones de US$) | | | 34.0 | 0.0 |
| e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR | | | | |
| ii. Compras de BTP (Valorizado) | | | | |
| **3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones** | **3 188,3** | **1 969,9** | **2 854,4** | **3 694,2** |
| **4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones** | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0.0195% | 0.0195% | 0.0195% | 0.0194% |
| b. Compra temporal directa de valores (Repos de subasta) | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| Tasa de interés | | | | |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | |
| Tasa de interés | | | | |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 589.0 | 93.0 | 1 207.0 | 2 297.5 |
| Tasa de interés | 4.00% | 4.00% | 4.00% | 4.00% |
| **5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones** | **2 599,3** | **1 876,9** | **1 647,4** | **1 396,7** |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*) | 13 933.7 | 13 585.0 | 13 381.1 | 13 198.1 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 6.6 | 6.5 | 6.4 | 6.3 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 7 275.5 | 6 929.1 | 6 722.9 | 6 540.0 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 3.5 | 3.3 | 3.2 | 3.1 |
| **6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP** | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 828.0 | 726.0 | 1 515.2 | 613.0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO | 6.75 / 6.75 / 6.75 | 6.75 / 6.75 / 6.75 | 6.75 / 6.75 / 6.75 | 6.75 / 6.75 / 6.75 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$) | 133.5 | 145.5 | 136.0 | 92.0 |
| 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 3 meses (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$)** | **Dic.22 2023** | **Dic.26 2023** | **Dic.27 2023** | **Dic.28 2023** |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + o | -507.8 | -78.6 | -29.2 | 77.6 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + o | -117.7 | -217.9 | 298.3 | 75.2 |
| a. Mercado spot con el público | -100.9 | -16.2 | 84.3 | 84.3 |
| i. Compras | 448.7 | 690.8 | 1037.9 | 527.0 |
| ii. (-) Ventas | 549.5 | 707.0 | 953.6 | 442.7 |
| b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega) | -140.0 | -29.8 | -324.2 | 16.8 |
| i. Pactadas | 210.6 | 29.9 | 426.8 | 165.4 |
| ii. (-) Vencidas | 350.7 | 59.6 | 750.9 | 148.6 |
| c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega) | -168.3 | -111.6 | 27.5 | -99.8 |
| i. Pactadas | 412.8 | 192.9 | 1199.5 | 195.7 |
| ii. (-) Vencidas | 581.1 | 304.5 | 1172.0 | 295.5 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | |
| i. Al contado | 418.3 | 182.0 | 497.4 | 351.5 |
| ii. A futuro | 340.0 | 35.0 | 222.0 | 26.0 |
| e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 223.9 | 217.7 | 671.4 | 140.9 |
| i. Compras | 571.7 | 275.5 | 1093.4 | 287.5 |
| ii. (-) Ventas | 347.7 | 57.8 | 422.0 | 146.6 |
| f. Efecto de Opciones | 4.7 | 0.5 | -4.0 | -16.0 |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -33.4 | -117.6 | -8.2 | -101.3 |
| h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | |
| Tasa de interés | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3.6826 | 3.6872 | 3.6914 | 3.7019 |
| (*) Datos preliminares | | | | |

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera