BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	29 Ene 24	30 Ene 24	31 Ene 24	01 Feb 24	02 Feb 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 782,2**	**8 394,0**	**8 084,6**	**9 146,9**	**8 523,0**
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	No opera	No opera	No opera	No opera	No opera
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Febrero del 2024	1 100.0	1 100.0	1 100.0	1 100.0	1 100.0
Vencimiento de CD BCRP del 5 al 9 de febrero de 2024				0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				2000.0 200.0 300.0 1900.0	500.0 300.0 500.0 2000.0
Propuestas recibidas				4550.0 600.0 640.0 4000.0	1000.0 700.0 750.0 4240.0
Plazo de vencimiento				1 d 32 d 7 d 1 d	3 d 31 d 91 d 3 d
Tasas de interés: Mínima				6.55 6.55 6.60 6.55	6.64 6.60 6.27 6.65
Máxima				6.60 6.60 6.60 6.60	6.65 6.61 6.35 6.67
Promedio				6.58 6.58 6.60 6.59	6.65 6.61 6.30 6.66
Saldo	8 711.5	7 911.5	7 911.5	12 311.5	11 261.5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 5 de Febrero del 2024	800.0	450.0	450.0	4 350.0	2 800.0
Vencimiento de Repo Valores del 5 al 9 de febrero de 2024	1 250.0	450.0	450.0	4 350.0	3 225.0
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 del 5 al 9 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	6 249.8	6 249.8	6 249.8
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 26 de Febrero del 2024	8.3	8.3	8.3	8.3	8.3
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 5 al 9 de febrero de 2024					0.0
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 (Excecial)					
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 Excecial - CDR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Excecial - CDR					
Vencimiento de Repo Excecial - CDR del 5 al 9 de febrero de 2024					
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acceso de Liquidez					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez					
Vencimientos de Repo de Cartera para el Acceso de Liquidez del 5 al 9 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 5 al 9 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 5 al 9 de febrero de 2024					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	4 000.0 2 797.0	3 999.8 4 338.7	4 000.0 2 878.2		
Propuestas recibidas	4 078.6 2 797.0	4 841.6 4 338.7	5 560.5 2 878.2		
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d		
Tasas de interés: Mínima	6.40 6.40	6.40 6.45	6.30 6.40		
Máxima	6.50 6.50	6.50 6.50	6.50 6.50		
Promedio	6.49 6.47	6.49 6.49	6.48 6.48		
Saldo	6 797.0	8 338.5	6 878.2		
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	6 797.0	8 338.5	6 878.2		
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 5 al 9 de febrero de 2024	6 797.0	8 338.5	6 878.2		
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)			300.0		
Propuestas recibidas			366.6		
Plazo de vencimiento			36 d		
Tasas de interés: Mínima			6.65		
Máxima			6.65		
Promedio			6.65		
Saldo	5 777.5	5 777.5	5 777.4	5 777.4	5 777.4
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 5 de Febrero del 2024	300.1	300.1	300.1	300.1	300.1
Vencimiento de Coloc-TP del 5 al 9 de febrero de 2024	300.1	300.1			900.1
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 5 al 9 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	295.0	295.0	295.0
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 5 al 9 de febrero de 2024					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 del 5 al 9 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 Repo Regular el 5 de Febrero del 2024	20.0	20.0	20.0	20.0	20.0
Vencimiento de REPO del 5 al 9 de febrero de 2024					20.0
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 5 al 9 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 Repo Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 5 al 9 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 Repo Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 5 al 9 de febrero de 2024					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0 160.0 300.0	160.0 10.0 40.0 200.0 200.0	200.0 200.0 129.0 300.0 300.0		200.0 200.0
Propuestas recibidas	300.0 249.0 575.0	190.0 160.0 182.0 453.0 465.0	410.0 295.0 129.0 1256.0 765.0		520.0 358.0
Plazo de vencimiento	274 d 366 d 366 d	98 d 274 d 366 d 98 d 274 d	97 d 274 d 365 d 98 d 98 d		94 d 272 d
Tasas de interés: Mínima	6.45 6.67 4.97	6.65 6.90 5.95 6.65 5.95	6.48 5.14 5.19 6.90 6.64		6.90 5.96
Máxima	6.80 5.95 5.99	6.75 6.90 5.95 5.75 6.90	6.90 6.95 5.95 6.90 6.95		6.90 5.96
Promedio	6.50 5.83 5.11	6.66 6.90 5.95 5.71 6.90	6.69 6.95 5.95 6.90 6.66		6.90 5.96
Saldo	40 209.8	40 376.8	40 006.8	40 006.8	40 209.8
Próximo vencimiento de SC-Venta el 6 de Febrero del 2024	620.0	600.0	200.0	200.0	548.0
Vencimiento de SC - Venta del 5 al 9 de febrero de 2024	1 420.0	800.0	200.0	200.0	2 048.0
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 5 al 9 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 5 al 9 de febrero de 2024					
b. Usual: 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	-1.0
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$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	1.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	3.8
Tipo de cambio promedio	0.0	0.1	0.1	0.5	18.5
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	0.1	0.1	0.5	18.5
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3 427,3**	**1 455,6**	**3 147,6**	**13 546,9**	**11 824,0**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
(Vencimiento Tasas efectivas diarias)	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%
b. Compra temporal directa de valores (Repo de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2 186.0	272.0	1 974.2	114.0	100.0
Tasa de interés	3.75%	3.75%	3.75%	3.75%	3.75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 241,3**	**1 183,6**	**1 173,4**	**13 432,9**	**11 724,0**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13 303.9	13 109.1	12 953.0	12 807.8	20 514.4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	6.3	6.2	6.1	6.1	9.7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 159.9	5 965.1	5 809.0	5 663.8	13 432.9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	2.9	2.8	2.7	2.7	6.3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	984.0	535.5	1 246.0	1 279.0	1 791.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6.50 / 6.50 / 6.50	6.50 / 6.50 / 6.50	6.50 / 6.50 / 6.62	6.50 / 6.50 / 6.50	6.50 / 6.50 / 6.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	234.0	246.0	287.0	89.0	110.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.75 / 5.53	5.50 / 5.75 / 5.53	5.50 / 5.75 / 5.53	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.26 2024**	**Ene.29 2024**	**Ene.30 2024**	**Ene.31 2024**	**Feb.01 2024**
Plazo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f.i + g	63.5	26.8	-111.8	101.9	-108.3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-257.3	126.2	-82.2	68.0	257.6
a. Mercado spot con el público	-151.1	139.4	-52.3	83.1	293.5
i. Compras	620.9	760.4	464.5	958.5	669.2
ii. (-) Ventas	772.0	621.1	516.8	873.4	375.7
b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega)	68.9	16.3	115.3	121.9	-296.7
i. Pactadas	89.4	335.7	162.4	145.4	112.1
ii. (-) Vencidas	20.4	319.4	47.0	23.5	408.8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	79.2	207.9	142.9	228.9	69.4
i. Pactadas	323.1	608.2	363.5	558.3	551.8
ii. (-) Vencidas	243.9	400.3	220.6	329.4	482.4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	402.4	320.9	384.6	443.9	530.6
ii. A futuro	5.0	35.0	125.0	190.0	155.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entregas	108.3	70.9	171.7	272.6	56.8
i. Compras	124.7	384.4	217.3	295.9	453.6
ii. (-) Ventas	16.4	313.5	45.6	23.2	397.0
f. Efecto de Opciones	0.2	-3.5	-0.4	0.4	0.2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	339.9	92.5	-29.6	158.7	-19.0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7871	3.8059	3.8119	3.8016	3.8037

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera