BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	05 Feb 24	06 Feb 24	07 Feb 24	08 Feb 24	09 Feb 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**10 215,8**	**9 970,1**	**10 323,6**	**9 791,0**	**13 748,1**
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					300.0
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCR)					690.0
Procuestas recibidas					186.4
Plazo de vencimiento					4 días
Tasas de interés: Mínima					4.45
Máxima					4.50
Promedio					4.50
Saldo	96 998.5	96 998.5	96 998.5	96 998.5	97 294.9
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 12 al 16 de febrero de 2024	0.0				1 400.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	500.0 1000.0				Desierta
Procuestas recibidas	1000.0 2020.0				850.0
Plazo de vencimiento	1 d 1 d				91 d
Tasas de interés: Mínima	6.64 6.65				
Máxima	6.65 6.67				
Promedio	6.65 6.66				
Saldo	9 961.5	8 461.5	8 461.5	8 161.5	8 036.5
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 16 de Febrero del 2024	1 500.0	300.0	300.0	125.0	50.0
Vencimiento de Reco Valores del 12 al 16 de febrero de 2024	1 925.0	425.0	425.0	125.0	50.0
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 12 al 16 de febrero de 2024					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 249.8	6 249.8	6 249.8	6 249.8	6 249.8
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 26 de Febrero del 2024	8.3	8.3	8.3	8.3	8.3
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 12 al 16 de febrero 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 (Esacrial)					
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 Esacrial - CDR					
Vencimiento de Reco Esacrial - CDR del 12 al 16 de febrero 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 12 al 16 de febrero 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 12 al 16 de febrero 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 12 al 16 de febrero de 2024					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)				800.0	4 158.8
Procuestas recibidas				2 674.8	4 518.8
Plazo de vencimiento				1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima				3.81	5.60
Máxima				6.31	6.25
Promedio				5.65	5.98
Saldo				800.0	4 158.8
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 12 de Febrero del 2024				800.0	4 158.8
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 12 al 16 de febrero de 2024				800.0	4 158.8
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)		300.0			
Procuestas recibidas		428.5			
Plazo de vencimiento		31 d			
Tasas de interés: Mínima		4.66			
Máxima		4.67			
Promedio		4.67			
Saldo	5 477.3	5 477.3	5 477.3	5 177.3	5 177.3
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 12 de Febrero del 2024	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 12 al 16 de febrero de 2024	600.0	300.0	300.0		1 004.0
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 12 al 16 de febrero 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	295.0	295.0	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 12 al 16 de febrero de 2024	0.0				
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación 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 12 al 16 de febrero de 2024					
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	167.0	167.0	167.0	167.0	167.0
Próximo vencimiento de Reco Regular el 28 de Febrero del 2024	22.0	22.0	22.0	22.0	22.0
Vencimiento de REPO del 12 al 16 de febrero de 2024	0.0				
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 REPO del 12 al 16 de febrero 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 12 al 16 de febrero 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 12 al 16 de febrero de 2024					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0 200.0	40.0 Desierta 300.0	300.0 200.0 40.0	164.0 200.0 200.0 300.1	200.0 180.0 120.0 160.0
Procuestas recibidas	487.0 360.8	140.0 -.- 580.0	435.0 225.0 130.0	265.0 880.0 795.0 826.0	401.0 235.0 170.0 190.0
Plazo de vencimiento	274 d 274 d	274 d 366 d 274 d	274 d 274 d 274 d	274 d 274 d 161 d 274 d	367 d 367 d 90 d 277 d
Tasas de interés: Mínima	6.36 6.46	6.46 - 6.95	6.63 6.48 6.46	6.63 6.60 6.16 6.16	6.14 6.16 6.40 6.63
Máxima	6.45 6.46	6.46 - 6.95	6.64 6.48 6.46	6.64 6.67 6.16 6.16	6.16 6.40 6.46 6.64
Promedio	6.40 6.46	6.46 - 6.95	6.64 6.48 6.46	6.63 6.62 6.16 6.16	6.16 6.17 6.46 6.63
Saldo	60 999.9	60 499.9	60 465.8	60 954.9	60 964.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 12 de Febrero del 2024	548.0	500.0	460.0	600.0	700.0
Vencimiento de SC - Venta del 12 al 16 de febrero de 2024	2 048.0	1 500.0	1 000.0	600.0	2 265.0
xxi. Subasta de Reco de Valores cara anower dólares (RED)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 12 al 16 de febrero 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 12 al 16 de febrero de 2024					
b. Usual. Renov 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	-85.0	-382.5	-11.6	0.0	-3.9
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	22.0	99.0	3.0	0.0	1.0
Tipo de cambio promedio	3.9	3.9	3.9	0.0	3.9
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.2	0.5	0.2	0.1	0.9
i. Compras (millones de US$)	0.2	0.5	0.2	0.1	0.9
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP. CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**11 630.8**	**9 887.5**	**10 311.9**	**9 237.8**	**9 743.2**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	n.n/a/%	n.n/a/%	n.n/a/%	n.n/a/%	n.n/a/%
(Tipo de cambio de la operación)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
Tasa de interés					
b. Compra temporal diaria de valores (Repo de subasta)					
c. Crédito por reducción monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	424.0	448.0	606.0	162.0	1 766.0
Tasa de interés	3.75%	3.75%	3.75%	3.75%	3.75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**11 206.8**	**9 439.5**	**9 705.9**	**9 075.8**	**7 977.2**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	19 147.3	18 918.0	18 323.1	18 164.5	17 871.4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9.0	8.9	8.6	8.5	8.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	12 065.7	11 836.4	11 241.5	11 082.9	10 769.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.7	5.6	5.3	5.2	5.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 433.1	1 881.8	2 099.9	2 204.0	1 575.8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6.50 / 6.50 / 6.50	6.50 / 6.50 / 6.50	6.50 / 6.50 / 6.50	6.50 / 6.50 / 6.50	6.25 / 6.25 / 6.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	84.0	201.0	340.0	422.0	273.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5.50 / 5.50 / 5.50	5.50 / 5.55 / 5.51	5.50 / 5.55 / 5.51	5.50 / 5.55 / 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 ponderado)					
Plazo hasta 6 meses (monto / tasa ponderado)					
Plazo hasta 12 meses (monto / tasa ponderado)					
Plazo hasta 24 meses (monto / tasa ponderado)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**Feb.02 2024**	**Feb.05 2024**	**Feb.06 2024**	**Feb.07 2024**	**Feb.08 2024**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	20.0	85.9	-60.7	39.8	-5.7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-166.3	89.8	-53.6	199.1	12.6
a. Mercado spot con el público	-139.0	87.0	-132.5	223.0	31.9
i. Compras	507.4	560.8	627.6	945.7	655.7
ii. (-) Ventas	646.4	473.8	760.0	722.7	623.9
b. Compras forward y swap al público (con v sin entrega)	276.3	-146.3	49.1	94.6	-172.0
i. Pactadas	294.0	44.6	358.4	221.5	405.7
ii. (-) Vencidas	17.8	190.8	309.3	126.9	577.7
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	138.9	-38.9	-3.6	257.4	-33.7
i. Pactadas	280.4	294.3	437.0	719.3	674.8
ii. (-) Vencidas	141.5	333.2	440.6	461.9	708.5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	475.1	425.2	695.9	749.7	578.5
ii. A futuro	70.0	120.0	79.0	224.0	30.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entregs	99.5	127.1	120.7	398.4	114.2
i. Compras	112.6	317.8	412.4	430.6	687.9
ii. (-) Ventas	13.2	190.6	291.8	124.2	573.7
f. Efecto de Opciones	-1.3	-0.2	-2.2	-3.8	1.5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	47.8	121.6	32.0	12.0	115.8
h. Crédito por reducción monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.8328	3.8595	3.8566	3.8670	3.8509
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera