BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	26 Feb 24		27 Feb 24		28 Feb 24		29 Feb 24		01 Mar 24		
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 444.6**		**8 978.8**		**9 458.5**		**8 724.1**		**8 144.9**		
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)					300.0						
Procesuetas recibidas					600.0						
Plazo de vencimiento					182 d						
Tasas de interés: Mínima					6.45						
Máxima					6.45						
Promedio					6.45						
Saldo	17 494.6		17 494.6		17 194.6		17 194.6		17 194.6		
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Marzo del 2024	600.0		600.0		1 652.7		1 652.7		1 652.7		
Vencimiento de CD BCRP del 4 al 8 de marzo de 2024	600.0		600.0		0.0		0.0		0.0		
ii. Subasta de Correra Temporal de Valores (REPO)									2000.0	300.0	1000.0
Procuestas recibidas									3550.0	400.0	1000.0
Plazo de vencimiento									3 d	91 d	3 d
Tasas de interés: Mínima									6.26	6.10	6.30
Máxima									6.29	6.14	6.30
Promedio									6.27	6.12	6.30
Saldo	8 186.5		8 186.5		8 186.5		8 186.5			11 186.5	
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 4 de Marzo del 2024	300.0		300.0		300.0		300.0			3 500.0	
Vencimiento de Reco Valores del 4 al 8 de marzo de 2024	300.0		300.0		300.0		300.0			3 500.0	
iii. Subasta de Correra 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 4 al 8 de marzo de 2024											
iv. Subasta de Correra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)											
Procuestas recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo	6 241.6		6 241.6		6 241.6		6 241.6		6 241.6		
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 20 de Marzo del 2024	4.2		4.2		4.2		4.2		4.2		
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 4 al 8 de marzo de 2024	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0		
v. Subasta de Correra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)											
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 Correra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Esxecial)											
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 Correra Temporal de Valores (REPO Esxecial - CDR)											
Procuestas recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de REPO Esxecial - CDR											
Vencimiento de Reco Esxecial - CDR del 4 al 8 de marzo de 2024											
viii. Subasta de Correra Temporal de Cartera de Créditos para el Aporo de Liquidez											
Procuestas recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de Reco de Cartera para el Aporo de Liquidez											
Vencimientos de Reco de Cartera para el Aporo de Liquidez del 4 al 8 de marzo 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 4 al 8 de marzo 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 4 al 8 de marzo de 2024											
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 000.1	5 299.9	2 980.0	4 162.4	3 000.0	6 500.0	4 000.1	5 100.0			
Procuestas recibidas	3 744.6	5 800.9	2 980.0	4 162.4	6 221.0	6 524.1	5 821.3	5 288.9			
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d			
Tasas de interés: Mínima	6.20	6.10	6.20	6.15	6.18	6.10	6.19	6.15			
Máxima	6.24	6.25	6.25	6.25	6.25	6.25	6.25	6.25			
Promedio	6.23	6.23	6.24	6.23	6.23	6.23	6.23	6.22			
Saldo	8 300.0		7 142.4		9 500.0		9 100.1				
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	8 300.0		7 142.4		9 500.0		9 100.1				
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 4 al 8 de marzo de 2024	8 300.0		7 142.4		9 500.0		9 100.1				
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0		300.0		300.0					271.3	
Procuestas recibidas	988.9		583.0		515.0					498.3	
Plazo de vencimiento	29 d		29 d		33 d					32 d	
Tasas de interés: Mínima	6.95		6.95		6.94					6.95	
Máxima	6.97		6.98		6.97					6.97	
Promedio	6.97		6.98		6.95					6.96	
Saldo	3 773.2		3 773.1		3 773.1		3 473.1			3 444.4	
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 4 de Marzo del 2024	300.1		300.0		300.0		300.0			200.0	
Vencimiento de Coloc-TP del 4 al 8 de marzo de 2024	1 200.1		900.0		600.0		300.0			1 358.9	
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 4 al 8 de marzo 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	285.0		65.0		65.0		65.0			65.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 8 de Mayo del 2024	220.0		65.0		65.0		65.0			65.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 4 al 8 de marzo de 2024	220.0		0.0		0.0		0.0			0.0	
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)											
Procuestas recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR											
Vencimientos de CD BCRP del 4 al 8 de marzo 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		145.0		145.0			145.0	
Próximo vencimiento de Reco Regular el 14 de Marzo del 2024	22.0		22.0		25.0		25.0			25.0	
Vencimiento de REPO del 4 al 8 de marzo de 2024	22.0		22.0		0.0		0.0			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 4 al 8 de marzo 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 Reco Expansion											
Vencimiento de REPO Expansión del 4 al 8 de marzo 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 4 al 8 de marzo de 2024											
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	55.0	160.0									
Procuestas recibidas	155.0	160.0									
Plazo de vencimiento	366 d	92 d									
Tasas de interés: Mínima	6.40	6.46									
Máxima	6.45	6.65									
Promedio	6.41	6.60									
Saldo	54 916.9		55 041.9		55 365.9		55 735.9		55 795.9		
Próximo vencimiento de SC-Venta el 4 de Marzo del 2024	70.0		70.0		70.0		600.0		300.0		
Vencimiento de SC - Venta del 4 al 8 de marzo de 2024	670.0		670.0		670.0		600.0		970.0		
xxi. Subasta de Reco de Valores para proveer dólares (RED)											
Procuestas recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de RED											
Vencimiento de RED del 4 al 8 de marzo 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 4 al 8 de marzo 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		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	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0		
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.8		1.7		3.4		8.9		0.0		
i. Compras (millones de US$)	0.8		1.7		3.4		8.9		0.0		
ii. Ventas (millones de US$)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0		
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0		
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR											
ii. Compras de BTP (Valorizado)											
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 098.5**		**3 848.8**		**1 803.7**		**1 525.3**		**11 694.9**		
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones											
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).											
(Contratos Tipo efectivo diario)	n.n/79%		n.n/80%		n.n/80%		n.n/79%		n.n/80%		
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	n.n		n.n		n.n		n.n		n.n		
Tasa de interés											
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional											
Tasa de interés											
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	371.0		969.0		305.0		596.0		410.0		
Tasa de interés	3.75%		3.75%		3.75%		3.75%		3.75%		
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 727.5**		**2 879.8**		**1 498.7**		**929.3**		**11 284.9**		
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13 412.7		13 201.6		10 314.6		12 964.2		12 780.2		
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	6.3		6.2		4.9		6.1		6.0		
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 528.3		6 161.6		6 085.6		5 679.8		5 695.8		
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	3.0		2.9		2.9		2.7		2.7		
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP											
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	685.0		1 133.8		530.0		716.8		1 220.0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6.25 / 6.25 / 6.25		6.25 / 6.25 / 6.25		6.25 / 6.25 / 6.25		6.25 / 6.25 / 6.25		6.25 / 6.25 / 6.25		
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	280.0		330.0		347.0		184.0		130.0		
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$)	**Feb.23 2024**		**Feb.26 2024**		**Feb.27 2024**		**Feb.28 2024**		**Feb.29 2024**		
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-113,3		56,1		44,5		72,9		-111,8		
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-2,5		-17,6		-45,1		73,4		-11,4		
a. Mercado spot con el público	10,7		11,6		41,5		78,0		0,1		
i. Compras	558,2		1065,7		551,8		552,7		880,0		
ii. (-) Ventas	547,5		1054,0		510,3		473,9		879,9		
b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega)	119,6		211,2		-138,2		13,7		156,8		
i. Pactadas	246,7		252,6		584,8		314,5		443,0		
ii. (-) Vencidas	127,1		41,4		723,0		300,8		286,3		
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	173,0		140,3		-167,0		92,5		372,3		
i. Pactadas	388,7		352,4		586,3		512,2		785,8		
ii. (-) Vencidas	215,6		212,1		753,3		419,7		413,4		
d. Operaciones cambiarias interbancarias											
i. Al contado	864,7		397,3		932,6		646,8		732,1		
ii. A futuro	10,0		17,0		105,0		103,0		80,0		
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entregas	74,9		159,2		10,2		115,0		118,2		
i. Compras	200,8		198,9		730,3		413,3		392,5		
ii. (-) Ventas	126,0		39,7		720,1		298,4		274,3		
f. Efecto de Opciones	1,1		0,4		1,4		-0,5		1,6		
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-57,9		-15,2		-7,1		77,3		111,1		
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera											
Tasa de interés											
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,7963		3,7996		3,7885		3,7948		3,7782		

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera