BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	16 Abr 24	16 Abr 24	17 Abr 24	18 Abr 24	19 Abr 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**10 008,5**	**10 016,0**	**9 600,4**	**10 156,3**	**7 515,7**
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)					
Procuestas recibidas	100.0	200.0	200.0	300.0	300.0
Procuestas recibidas	530.0	647.3	585.0	824.0	933.3
Plazo de vencimiento	183 d	182 d	181 d	182 d	185 d
Tasas de interés: Mínima	6.45	6.45	6.48	6.46	6.44
Máxima	6.50	6.50	6.50	6.50	6.47
Promedio	6.50	6.50	6.50	6.48	6.46
Saldo	10 914.0	10 914.0	10 914.0	10 464.7	10 914.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 22 de Abril del 2024	1 800.0	1 800.0	1 800.0	1 565.0	1 565.0
Vencimiento de CD BCRP del 22 al 26 de abril de 2024	1 800.0	1 800.0	1 800.0		2 067.0
ii. Subasta de Comora Temporal de Valores (REPO)					200.0 300.0
Procuestas recibidas					600.0 700.0
Plazo de vencimiento					31 d 91 d
Tasas de interés: Mínima					6.21 5.98
Máxima					6.23 5.99
Promedio					6.22 5.99
Saldo	8 186.5	8 186.5	8 186.5	8 186.5	8 306.5
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 26 de Abril del 2024	380.0	380.0	380.0	380.0	300.0
Vencimiento de Reco Valores del 22 al 26 de abril de 2024	380.0	380.0	380.0	380.0	300.0
iii. Subasta de Comora 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 22 al 26 de abril de 2024					
iv. Subasta de Comora Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 207.2	6 207.2	6 207.2	6 207.2	6 207.2
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 11 de Julio del 2024	2.5	2.5	2.5	2.5	2.5
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 22 al 26 de abril de 2024	0.0		0.0		
v. Subasta de Comora Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Reactiar)					
Garantía cara 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 Comora Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Exsecial)					
Garantía cara 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 Comora Temporal de Valores (RREPO Especial - CDR)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Exsecial - CDR					
Vencimiento de Reco Exsecial - CDR del 22 al 26 de abril de 2024					
viii. Subasta de Comora Temporal de Cartera de Créditos cara el Aoovo de Liouidez					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco de Cartera cara el Aoovo de Liouidez					
Vencimientos de Reco de Cartera cara el Aoovo de Liouidez del 22 al 26 de abril de 2024					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Márcen: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 22 al 26 de abril 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 22 al 26 de abril de 2024					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 000.0 3 900.0	3 000.0 3 400.1	3 000.0 3 299.9	3 500.0 2 771.5	2 500.0 2 400.0
Procuestas recibidas	4 959.2 4 604.5	5 083.1 4 995.9	4 958.7 5 132.6	4 078.7 2 771.5	4 957.2 2 954.4
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	5.70 5.60	5.80 5.70	5.80 5.50	5.70 5.73	5.60 5.65
Máxima	5.96 6.00	5.96 5.95	5.92 5.87	5.94 5.99	5.86 5.94
Promedio	5.87 5.91	5.91 5.86	5.88 5.75	5.83 5.83	5.82 5.81
Saldo	6 900.0	6 400.1	6 299.9	6 271.5	4 900.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 22 de Abril del 2024	6 900.0	6 400.1	6 299.9	6 271.5	4 900.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 22 al 26 de abril de 2024	6 900.0	6 400.1	6 299.9	6 271.5	4 900.0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 400.0	2 400.0	2 400.0	2 400.0	2 400.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 25 de Abril del 2024	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 22 al 26 de abril de 2024	0.0		0.0		600.0
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 22 al 26 de abril 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	65.0	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	65.0
Vencimiento de CDR BCRP del 22 al 26 de abril de 2024	0.0		0.0		
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Remuneración Reajustable (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 22 al 26 de abril de 2024					
xvi. Comora con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reculer)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	50.0	50.0	50.0	50.0	50.0
Próximo vencimiento de Reco Reculer el 8 de Mayo del 2024	25.0	25.0	25.0	25.0	25.0
Vencimiento de REPO del 22 al 26 de abril de 2024	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 RREPO del 22 al 26 de abril de 2024					
xviii. Comora con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Excansión)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco Excansion					
Vencimiento de REPO Excansión del 22 al 26 de abril de 2024					
xix. Comora 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 22 al 26 de abril de 2024					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300.0 275.0 300.0	200.0 140.0 200.0	298.0 200.0		
Procuestas recibidas	740.0 520.0 779.0	370.0 140.0 570.0	418.0 530.0		
Plazo de vencimiento	91 d 184 d 91 d	92 d 183 d 92 d	91 d 92 d		
Tasas de interés: Mínima	4.66 4.47 4.67	4.64 4.51 4.45	4.66 4.74		
Máxima	4.75 4.49 4.68	4.75 4.65 4.64	4.80 4.76		
Promedio	4.70 4.55 4.68	4.73 4.65 4.55	4.74 4.74		
Saldo	47 507.9	47 207.8	47 706.9	47 706.9	47 290.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 22 de Abril del 2024	300.0	399.8	415.0	415.0	300.0
Vencimiento de SC - Venta del 22 al 26 de abril de 2024	1 114.9	814.9	415.0	415.0	2 300.1
xxi. Subasta de Reco de Valores cara orcwer dólares (RED)					
Procuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 22 al 26 de abril 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 22 al 26 de abril de 2024					
b. Liquid. Reros 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$)	-143.2	23.9	0.0	0.4	0.5
i. Compras (millones de US$)	0.2	23.9	0.0	0.4	0.5
ii. Ventas (millones de US$)	143.4	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	25.2	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	25.2				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 784.8**	**5 317.8**	**4 939.4**	**5 898.4**	**4 741.3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Comora temporal de moneda extranjera (swaps).					
(Tamaño (sea efectivo diario)	0.0 [illegible]	0.0 [illegible]	0.0 [illegible]	0.0 [illegible]	0.0 [illegible]
b. Comora temporal diaria de valores (Sara de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés					
c. Crédito por reculación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	295.0	810.6	320.1	932.3	1 149.2
Tasa de interés	3.75%	3.75%	3.75%	3.75%	3.75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**4 489.8**	**4 507.0**	**4 619.3**	**4 966.1**	**3 592.1**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13 741.7	13 626.7	13 515.5	13 434.2	13 347.5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.5	6.5	6.4	6.3	6.3
c. Cuenta corriente moneda nacional oromedio acumulado (millones de S/)	6 550.2	6 433.5	6 321.2	6 232.9	6 152.9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.1	3.0	3.0	2.9	2.9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 249.8	1 550.3	2 207.0	1 271.0	2 206.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6.00 / 6.00 / 6.00	6.00 / 6.00 / 6.00	6.00 / 6.00 / 6.00	6.00 / 6.00 / 6.00	6.00 / 6.00 / 6.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	85.0	85.0	85.0	90.0	95.0
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 oromedio)					
Plazo hasta 6 meses (monto / tasa oromedio)					
Plazo hasta 12 meses (monto / tasa oromedio)					
Plazo hasta 24 meses (monto / tasa oromedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**Abr.12 2024**	**Abr.15 2024**	**Abr.16 2024**	**Abr.17 2024**	**Abr.18 2024**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e.1 + f.1 + g	60.9	50.9	151.5	-143.2	72.4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e.1 + g	-93.3	147.3	121.7	-100.4	-90.3
a. Mercado spot con el público	-94.9	155.3	110.1	-107.2	-76.1
i. Compras	433.5	1 147.4	498.3	607.0	799.6
ii. (-) Ventas	528.4	992.1	388.2	714.1	877.7
b. Compras forward y swap al público (con v sin entrega)	189.2	-179.1	84.8	94.6	-192.3
i. Pactadas	215.1	107.5	327.6	317.0	472.9
ii. (-) Vencidas	26.0	286.6	243.0	222.4	665.1
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-11.4	-61.5	104.0	166.9	-352.6
i. Pactadas	186.4	410.4	609.4	683.4	555.4
ii. (-) Vencidas	197.8	471.9	505.4	516.6	908.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	378.4	320.3	513.2	484.4	433.2
ii. A futuro	123.0	75.0	57.0	58.0	185.0
e. Operaciones soct asociadas a swaos v vencimientos de forwards sin entreoa	173.9	174.1	275.6	301.1	230.4
i. Compras	185.3	432.9	503.6	515.0	886.2
ii. (-) Ventas	11.4	258.8	228.0	213.9	655.8
f. Efecto de Opciones	4.0	-4.2	-13.3	2.7	2.3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-51.0	28.7	60.9	26.5	0.2
h. Crédito por reculación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7035	3.7259	3.7575	3.7436	3.7327
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera