BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	15 Ene 24		16 Ene 24		17 Ene 24		18 Ene 24		19 Ene 24	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**13 713,8**		**13 969,5**		**12 070,8**		**10 820,8**		**8 704,4**	
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)										
Procesadas recibidas	600.0	400.0	600.0	399.9	600.0	400.0				
Plazo de vencimiento	1855.0	1190.0	1454.0	1129.0	1365.0	646.0				
Tasas de interés: Mínima	183 d	366 d	182 d	365 d	181 d	364 d				
Máxima	6.40	6.17	6.64	6.99	6.60	6.99				
Promedio	6.70	6.53	6.66	6.96	6.67	6.93				
Saldo	6.47	6.27	6.65	6.94	6.65	6.94				
Próximo vencimiento de CD BCRP el 22 de Enero del 2024	98 791.8		98 791.8		98 791.8		98 791.8		98 791.8	
Vencimiento de CD BCRP del 22 al 26 de enero de 2024	501.9		501.9		501.9		501.9		501.9	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	0.0		0.0		0.0		0.0		1 551.9	
Procesadas recibidas									380.0	
Plazo de vencimiento									91 d	
Tasas de interés: Mínima									6.30	
Máxima									6.38	
Promedio									6.33	
Saldo	9 532.2		9 532.2		9 531.5		9 531.5		9 411.5	
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 26 de Enero del 2024	0.6		0.6		500.0		500.0		600.0	
Vencimiento de Reco Valores del 22 al 26 de enero de 2024	500.6		500.6		500.0		500.0		600.0	
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)										
Procesadas 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 enero de 2024										
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)										
Procesadas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	6 257.5		6 257.5		6 257.5		6 257.5		6 257.5	
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 22 de Enero del 2024	1.5		1.5		1.5		1.5		1.5	
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 22 al 26 de enero de 2024	0.0		0.0		0.0		0.0		1.5	
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)										
Garantía para los créditos										
Procesadas 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 (Especial)										
Garantía para los créditos										
Procesadas 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) Especial - CDR										
Procesadas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR										
Vencimiento de Reco Especial - CDR del 22 al 26 de enero de 2024										
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Acceso de Liquidez										
Procesadas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Reco de Cartera para el Acceso de Liquidez										
Vencimientos de Reco de Cartera para el Acceso de Liquidez del 22 al 26 de enero de 2024										
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)										
Procesadas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Mínimo: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de CDV BCRP										
Vencimientos de CDV BCRP del 22 al 26 de enero de 2024										
x. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)										
Procesadas 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 enero de 2024										
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 000.0	4 000.0	3 818.0	4 100.0	3 999.9	3 063.1	2 999.9	4 405.4	2 500.0	3 340.3
Procesadas recibidas	3 403.0	5 189.0	3 818.0	4 310.0	4 107.6	3 063.1	3 806.6	4 405.4	3 279.1	3 340.3
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	6.30	6.10	6.35	6.30	6.40	6.35	6.35	6.40	6.35	6.40
Máxima	6.50	6.50	6.50	6.50	6.50	6.50	6.50	6.50	6.50	6.50
Promedio	6.46	6.37	6.48	6.43	6.49	6.46	6.48	6.46	6.45	6.45
Saldo	7 000.0		7 918.0		7 063.0		7 405.3		5 840.3	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 22 de Enero del 2024	7 000.0		7 918.0		7 063.0		7 405.3		5 840.3	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 22 al 26 de enero de 2024	7 000.0		7 918.0		7 063.0		7 405.3		5 840.3	
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0		153.0		300.1		300.0		300.0	
Procesadas recibidas	698.0		658.0		809.0		437.0		952.1	
Plazo de vencimiento	31 d		31 d		34 d		34 d		36 d	
Tasas de interés: Mínima	6.58		6.55		6.55		6.54		6.52	
Máxima	6.60		6.57		6.58		6.58		6.58	
Promedio	6.58		6.58		6.53		6.55		6.55	
Saldo	5 233.4		5 223.4		5 388.5		5 447.5		5 447.5	
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 22 de Enero del 2024	163.0		155.0		221.0		300.0		300.0	
Vencimiento de Coloc-TP del 22 al 26 de enero de 2024	839.0		676.0		521.0		300.0		870.1	
xiii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación										
Procesadas 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 enero de 2024										
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)										
Procesadas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	230.0		230.0		230.0		230.0		230.0	
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 22 al 26 de enero de 2024	0.0		0.0		0.0		0.0			
xv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Reajustables Restringida (CDR BCRP-NR)										
Procesadas 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 enero de 2024										
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)										
Procesadas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	207.0		207.0		207.0		187.0		187.0	
Próximo vencimiento de Reco Regular el 5 de Febrero del 2024	20.0		20.0		20.0		20.0		20.0	
Vencimiento de REPO del 22 al 26 de enero de 2024	20.0		20.0		20.0		0.0			
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa										
Procesadas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Reco										
Vencimiento de RPO del 22 al 26 de enero de 2024										
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)										
Procesadas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Reco Expansion										
Vencimiento de REPO Expansión del 22 al 26 de enero de 2024										
xix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)										
Procesadas 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 enero de 2024										
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			300.0		Desierta	199.9 100.0	200.0			
Procesadas recibidas			750.0		---	557.5 464.0	587.0			
Plazo de vencimiento			366 d		366 d	91 d 366 d	365 d			
Tasas de interés: Mínima			4.95		0.00	4.90 4.95	4.98			
Máxima			4.99		0.00	5.00 5.05	4.99			
Promedio			4.99		0.00	5.00 5.05	4.99			
Saldo	48 610.9		48 610.9		47 047.8		47 190.8		47 190.8	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 24 de Enero del 2024	175.0		175.0		55.0		500.0		500.0	
Vencimiento de SC - Venta del 22 al 26 de enero de 2024	230.0		230.0		55.0		0.0		1 580.0	
xxi. Subasta de Reco de Valores para proveer dólares (RED)										
Procesadas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de RED										
Vencimiento de RED del 22 al 26 de enero de 2024										
xxii. Subasta de Swap de Tasas de Interés										
Procesadas 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 enero 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		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$)	0.0		0.4		0.1		0.8		0.4	
i. Compras (millones de US$)	0.0		0.4		0.1		0.8		0.4	
ii. Ventas (millones de US$)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP (Valorizado)										
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**6 986,3**		**5 239,1**		**5 350,9**		**4 500,7**		**4 607,7**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).										
(Contratos Tipo efectivo diario)	0.0000%		0.0000%		0.0000%		0.0000%		0.0000%	
b. Compra temporal directa de valores (Repo de subasta)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
Tasa de interés										
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	777.0		507.0		481.0		551.0		684.0	
Tasa de interés	3.75%		3.75%		3.75%		3.75%		3.75%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**6 209,3**		**4 732,1**		**4 869,9**		**3 949,7**		**3 923,7**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	16 646.8		15 894.4		15 571.1		15 381.2		15 107.1	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	7.9		7.5		7.4		7.3		7.1	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	9 546.7		8 750.4		8 427.1		8 237.2		7 963.1	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	4.5		4.1		4.0		3.9		3.8	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 003.6		687.7		1 091.6		1 087.0		933.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6.50 / 6.50 / 6.50		6.50 / 6.50 / 6.50		6.50 / 6.50 / 6.50		6.50 / 6.50 / 6.50		6.50 / 6.50 / 6.50	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	191.0		132.5		177.7		208.0		255.2	
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$)	**Ene.12 2024**		**Ene.15 2024**		**Ene.16 2024**		**Ene.17 2024**		**Ene.18 2024**	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f.i + g	-4.7		-12.1		12.1		-51.6		80.7	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-120.3		-107.3		70.8		22.8		132.9	
a. Mercado spot con el público	-18.4		-96.2		91.5		49.0		150.4	
i. Compras	571.8		223.9		790.4		531.8		644.7	
ii. (-) Ventas	590.2		314.1		699.0		482.0		494.3	
b. Contratos forward y swap al público (con v sin entrega)	48.5		72.9		16.2		-32.5		-346.3	
i. Pactadas	236.1		79.7		293.2		141.6		191.7	
ii. (-) Vencidas	187.6		6.8		277.1		174.1		538.0	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	130.3		-21.0		154.4		75.2		-255.3	
i. Pactadas	601.2		64.2		692.3		288.3		652.4	
ii. (-) Vencidas	471.0		85.2		537.9		213.1		907.7	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	610.4		127.5		679.2		669.8		720.9	
ii. A futuro	18.0		5.0		194.0		13.0		14.0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entregas	269.1		71.8		227.5		51.0		358.9	
i. Compras	452.4		76.5		492.6		211.0		879.0	
ii. (-) Ventas	183.3		4.7		265.1		160.0		520.1	
f. Efecto de Opciones	-2.3		1.2		-1.2		-0.6		-0.5	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	112.0		-10.4		93.3		-5.0		32.6	
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6937		3.6951		3.7166		3.7405		3.7388	

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera