BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	25 Mar 24	26 Mar 24	27 Mar 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**9 139,1**	**9 118,0**	**6 705,6**
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	94 844.4	93 909.4	93 083.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 26 de Marzo del 2024	1 311.0	470.0	1 800.0
Vencimiento de CD BCRP del 25 al 29 de marzo de 2024	1 781.0	470.0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			300.0
Propuestas recibidas			730.0
Plazo de vencimiento			93 d
Tasas de interés: Mínima			6.15
Máxima			6.20
Promedio			6.18
Saldo	7 986.5	7 986.5	8 686.5
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 5 de Abril del 2024	900.0	900.0	410.0
Vencimiento de Reco Valores del 25 al 29 de marzo de 2024	0.0	0.0	
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 Reco de Cartera General			
Vencimiento de Reco de Cartera General del 25 al 29 de marzo de 2024			
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	6 237.4	6 237.4	6 237.4
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 22 de Abril del 2024	1.7	1.7	1.7
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 25 al 29 de marzo de 2024	0.0	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
vi. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)			
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
vii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO Especial - CDR)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo			
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR			
Vencimiento de Reco Especial - CDR del 25 al 29 de marzo de 2024			
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Apoyo de Liquidez			
Propuestas 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 25 al 29 de marzo 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 25 al 29 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 25 al 29 de marzo de 2024			
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	5 000.0 2 068.7	4 999.9 3 205.0	3 000.0 4 900.0
Propuestas recibidas	5 194.0 2 068.7	5 366.6 3 205.0	4 697.3 5 373.5
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	5 d 5 d
Tasas de interés: Mínima	6.15 6.15	6.18 6.16	6.08 6.10
Máxima	6.25 6.25	6.25 6.25	6.23 6.22
Promedio	6.23 6.22	6.22 6.22	6.19 6.18
Saldo	7 068.7	8 204.9	7 900.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 25 de Marzo del 2024	7 068.7	8 204.9	7 900.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 25 al 29 de marzo de 2024	7 068.7	8 204.9	
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0	300.0	300.0
Propuestas recibidas	892.4	842.3	681.2
Plazo de vencimiento	31 d	31 d	33 d
Tasas de interés: Mínima	6.38	6.38	6.30
Máxima	6.48	6.45	6.47
Promedio	6.40	6.33	6.36
Saldo	2 164.1	2 164.1	2 164.1
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 25 de Marzo del 2024	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 25 al 29 de marzo de 2024	600.0	300.0	
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 25 al 29 de marzo 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	65.0	65.0	65.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 6 de Marzo del 2024	65.0	65.0	65.0
Vencimiento de CDR BCRP del 25 al 29 de marzo de 2024	0.0	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 25 al 29 de marzo de 2024			
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	120.0	120.0	95.0
Próximo vencimiento de Reco Recular el 27 de Marzo del 2024	25.0	25.0	25.0
Vencimiento de REPO del 25 al 29 de marzo de 2024	25.0	25.0	0.0
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo			
Próximo vencimiento de Reco			
Vencimiento de REPO del 25 al 29 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 25 al 29 de marzo 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 Reco Sustitucion			
Vencimiento de REPO Sustitución del 25 al 29 de marzo de 2024			
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		300.0 300.0	300.0 300.0
Propuestas recibidas		1205.5 1420.0	1350.0 470.0
Plazo de vencimiento		91 d 91 d	89 d 98 d
Tasas de interés: Mínima		6.36 6.33	6.30 6.48
Máxima		6.38 6.48	6.30 6.80
Promedio		6.30 6.41	6.30 6.77
Saldo	47 934.9	47 634.9	47 484.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 26 de Marzo del 2024	310.0	730.0	200.0
Vencimiento de SC - Venta del 25 al 29 de marzo de 2024	1 040.0	730.0	
xxi. Subasta de Reco de Valores cees onower dólares (RED)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo			
Próximo vencimiento de RED			
Vencimiento de RED del 25 al 29 de marzo 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 25 al 29 de marzo de 2024			
b. Liquid. Reco Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)	0.0	0.0	0.0
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	5.2	-37.8	3.0
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	5.2	2.2	3.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	40.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP			
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR			
ii. Compras de BTP (Valorizado)			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 020,3**	**3 088,5**	**1 759,6**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (repos).			
Cantidad (tasa efectiva diaria)	0.0192%	0.0000%	0.0174%
b. Compra temporal diaria de valores (Repo de subasta)	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés			
c. Crédito por recalación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés			
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 480.0	1 401.0	320.5
Tasa de interés	6.75%	6.75%	6.75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2 540,3**	**1 687,5**	**1 439,1**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	13 818.3	13 636.3	13 416.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.6	6.5	6.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 898.5	6 716.5	6 496.5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.3	3.2	3.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	759.0	1 214.0	1 023.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	6.25 / 6.25 / 6.25	6.25 / 6.25 / 6.25	6.25 / 6.25 / 6.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	238.0	269.0	210.6
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	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$)	**Mar 22 2024**	**Mar.25 2024**	**Mar.26 2024**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-48,2	-1,1	100,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	105,1	45,3	218,8
a. Mercado spot con el público	153,3	70,3	259,7
i. Compras	1016,1	588,3	1051,5
ii. (-) Ventas	862,9	518,0	791,8
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	50,1	-339,4	22,2
i. Pactadas	545,6	581,1	272,8
ii. (-) Vencidas	495,5	920,5	250,6
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	259,7	-295,2	209,0
i. Pactadas	808,8	697,1	1208,3
ii. (-) Vencidas	549,1	992,4	999,3
d. Coberaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	821,8	461,5	824,4
ii. A futuro	138,0	100,0	213,0
e. Operaciones socl sociadas a swaos v vencimientos de forwards sin entrega	26,5	67,7	741,1
i. Compras	515,0	987,0	987,6
ii. (-) Ventas	488,5	919,2	246,6
f. Efecto de Opciones	3,5	-2,2	-10,3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	31,8	-20,9	45,8
h. Crédito por recalación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6912	3.7033	3.7273
(*) Datos preliminares			

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera