BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	20 May 24		21 May 24		22 May 24		23 May 24		24 May 24	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 520,2**		**8 178,8**		**7 441,7**		**7 670,4**		**6 119,2**	
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	200.0	200.0	200.0	200.0	300.0		300.1			
Plazo de vencimiento	615.0	500.0	490.0	475.0	837.4		615.0			
Tasas de interés: Mínima	92 d	179 d	91 d	185 d	93 d		92 d			
Máxima	5.51	5.28	5.49	5.26	5.47		5.47			
Promedio	5.51	5.28	5.49	5.27	5.50		5.50			
Saldo	36 350.6		35 450.6		35 950.6		35 403.6		35 403.6	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 28 de Mayo del 2024	1 500.0		997.1		997.1		1 074.7		1 074.7	
Vencimiento de CD BCRP del 27 al 31 de mayo de 2024	2 497.1		997.1		997.1		1 074.7		1 074.7	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)							300.0		300.0	500.0
Propuestas recibidas							1000.0		1000.0	1440.0
Plazo de vencimiento							32 d		32 d	91 d
Tasas de interés: Mínima							6.08		6.18	5.97
Máxima							6.13		6.18	6.06
Promedio							6.11		6.18	6.02
Saldo	8 406.5		8 406.5		8 406.5		8 706.5		9 006.5	
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 27 de Mayo del 2024	500.0		500.0		500.0		500.0		500.0	
Vencimiento de Repo Valores del 27 al 31 de mayo de 2024	500.0		500.0		500.0		500.0		800.0	
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 Repo de Cartera General										
Vencimiento de Repo de Cartera General del 27 al 31 de mayo de 2024										
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	6 207.2		6 207.2		6 207.2		6 207.2		6 207.2	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 11 de Julio del 2024	2.5		2.5		2.5		2.5		2.5	
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 27 al 31 de mayo de 2024										
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	53 999.9		53 999.9		53 999.9		53 999.9		53 999.9	
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		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 Repo Especial - CDR del 27 al 31 de mayo de 2024										
viii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos para el Ahorro de Liquidez										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Repo de Cartera para el Ahorro de Liquidez										
Vencimientos de Repo de Cartera para el Ahorro de Liquidez del 27 al 31 de mayo de 2024										
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Márgen: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de CDV BCRP										
Vencimientos de CDV BCRP del 27 al 31 de mayo 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 27 al 31 de mayo de 2024										
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 000.0	4 100.0	3 000.0	3 100.0	2 000.0	4 000.0	2 000.0	4 100.1	2 000.0	3 000.0
Propuestas recibidas	4 857.9	4 672.2	4 199.7	3 931.4	4 083.4	4 766.1	4 859.4	4 582.7	4 113.1	3 315.1
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de interés: Mínima	6.00	6.43	4.00	6.43	6.00	6.46	6.00	6.46	6.00	6.47
Máxima	6.65	6.75	6.67	6.74	6.65	6.75	6.65	6.75	6.69	6.74
Promedio	5.59	5.64	5.61	5.67	5.62	5.68	5.62	5.65	5.60	5.61
Saldo	6 400.0		6 400.0		6 300.0		6 400.1		5 000.0	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 27 de Mayo del 2024	6 100.0		6 100.0		6 000.0		6 400.1		5 000.0	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 27 al 31 de mayo de 2024	6 400.0		6 400.0		6 300.0		6 400.1		5 000.0	
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)										
Propuestas 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 27 de Mayo del 2024	300.0		300.0		300.0		300.0		300.0	
Vencimiento de Coloc-TP del 27 al 31 de mayo de 2024									900.0	
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 27 al 31 de mayo 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										
Próximo vencimiento de CDR BCRP										
Vencimiento de CDR BCRP del 27 al 31 de mayo de 2024										
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 27 al 31 de mayo de 2024										
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Repo Regular										
Vencimiento de REPO del 27 al 31 de mayo de 2024										
xvii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Repo										
Vencimiento de REPO del 27 al 31 de mayo 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 Repo Extensión										
Vencimiento de REPO Expansión del 27 al 31 de mayo 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 Repo Sustitución										
Vencimiento de REPO Sustitución del 27 al 31 de mayo de 2024										
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	Desierta	Desierta	75.0 -- --	70.0	Desierta	Desierta 250.0 --	45.0	400.0	185.0	300.0	300.0
Propuestas recibidas											690.0
Plazo de vencimiento	92 d	92 d	92 d	92 d	92 d	92 d	92 d	92 d	184 d	92 d	91 d
Tasas de interés: Mínima	0.00	-	6.00	6.05	-	-	6.05				5.89
Máxima	0.00	-	6.05	6.05	-	-	6.05				6.04
Promedio	0.00	-	6.02	6.05	-	-	6.05				5.96
Saldo	53 758.2			53 213.2				53 483.2			53 733.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 28 de Mayo del 2024	660.0			615.0				50.0		524.0	524.0
Vencimiento de SC - Venta del 27 al 31 de mayo de 2024	1 525.0			665.0				50.0			1 434.0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)											
Propuestas recibidas											
Plazo de vencimiento											
Tasas de interés: Mínima											
Máxima											
Promedio											
Saldo											
Próximo vencimiento de RED											
Vencimiento de RED del 27 al 31 de mayo de 2024											
xxii. Subasta de Repo 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 27 al 31 de mayo de 2024											
b. Operaciones Cambiarias Netas (Fondos OTC, PCR, Cambios Interbancarios y Mesa de Negociación del BCR)	-247.7			0.0				0.0			0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0			0.0				0.0			0.0
Tipo de cambio promedio	0.0			0.0				0.0			0.0
ii. Ventas (millones de US$)	65.0			0.0				0.0			0.0
Tipo de cambio promedio	3.7			0.0				0.0			0.0
d. Operaciones Cambiarias Netas (millones de US$)	3.3			0.2				0.3			1.6
i. Compras (millones de US$)	3.3			0.2				0.3			1.6
ii. Ventas (millones de US$)											
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0			0.0				31.2			0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR											
ii. Compras de BTP (Monto)								31.2			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3 899,0**			**3 873,1**				**3 146,2**			**3 971,5**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones											
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).											
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0180%			0.0176%				0.0174%			0.0169%
b. Compra temporal directa de valores (Repo de subasta)	0.0			0.0				0.0			0.0
Tasa de interés											
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional											
Tasa de interés											
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	307.0			442.0				364.0			350.0		530.0
Tasa de interés	3.50%			3.50%				3.50%			3.50%		3.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3 592,0**			**3 431,1**				**2 782,2**			**3 393,7**		**3 441,5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	13 455.7			13 324.6				13 192.1			13 002.6		12 816.0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8.5			8.2				8.1			8.1		8.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 516.8			6 405.7				6 263.2			6 083.6		5 997.0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.0			3.0				2.8			2.8		2.8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP											
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 418.0			954.0				866.0			761.5		1 165.9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIM*	4.7% / 4.7% / 4.3%			4.3% / 5.3% / 4.3%				4.3% / 4.3% / 4.3%			4.3% / 4.3% / 4.3%		4.3% / 4.3% / 4.3%
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	598.5			164.0				179.5			150.0		166.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4.50 / 4.50 / 4.50			4.50 / 4.50 / 4.50				4.50 / 4.50 / 4.50			4.50 / 4.50 / 4.50		4.50 / 4.50 / 4.50
c. Total mercado secundario de CTS/BCRP/BB,LB y TTV												
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$)	**May. 17 2024**			**May. 20 2024**				**May. 21 2024**			**May. 22 2024**		**May. 23 2024**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + o	4.8			-185.4				-56.7			59.4		37.2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	144.4			155.4				-39.4			129.7		-70.4
a. Mercado spot con el público	159.2			87.8				-33.2			129.7		-8.1
i. Compras	753.4			741.8				646.9			620.7		854.7
ii. (-) Ventas	594.2			654.0				680.1			491.0		862.8
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	32.3			-176.1				15.0			39.7		-259.9
i. Pactadas	113.3			252.9				154.8			159.1		357.1
ii. (-) Vencidas	81.0			429.0				139.8			119.4		608.0
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	26.9			21.1				-109.9			178.7		-366.2
i. Pactadas	401.6			335.9				281.5			648.9		637.7
ii. (-) Vencidas	374.7			314.9				391.4			469.2		1003.9
d. Operaciones cambiarias interbancarias												
i. Al contado	329.2			547.9				385.1			603.6		522.0
ii. A futuro	90.0			270.0				10.0			60.0		70.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	267.2			-112.7				249.1			348.3		358.1
i. Compras	344.6			309.1				387.8			467.3		965.6
ii. (-) Ventas	77.4			421.9				138.7			119.0		607.5
f. Efecto de Opciones	-0.5			-4.9				1.2			-5.2		5.3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-132.7			-72.4				-147.1			76.4		-37.5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera												
Tasa de interés												
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7410			3.7333				3.7303			3.7410		3.7433

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera