BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	27 May 24	28 May 24	29 May 24	30 May 24	31 May 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**6 863,5**	**8 591,3**	**8 555,6**	**8 127,6**	**5 561,1**
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)		200,0 200,0	200,0		
Propuestas recibidas		540,0 385,0	274,5		
Plazo de vencimiento		185 d 92 d	91 d		
Tasas de interés: Mínima		5,26 5,48	5,28		
Máxima		5,27 5,49	5,49		
Promedio		5,27 5,48	5,48		
Saldo	35 403,6	34 930,6	35 230,6	35 230,6	35 230,6
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Junio del 2024	1 074,7	1 350,0	1 350,0	1 350,0	1 350,0
Vencimiento de CD BCRP del 3 al 7 de junio de 2024	1 074,7	0,0	0,0		
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	500,0				300,0 300,0
Propuestas recibidas	1300,0				900,0 900,0
Plazo de vencimiento	31 d				35 d 90 d
Tasas de interés: Mínima	6,03				6,13 5,99
Máxima	6,06				6,13 6,03
Promedio	6,05				6,13 6,01
Saldo	9 006,5	9 006,5	9 006,5	9 006,5	9 306,5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 31 de Mayo del 2024	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Repo Valores del 3 al 7 de junio de 2024	300,0	300,0	300,0	300,0	600,0
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 3 al 7 de junio 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 3 al 7 de junio de 2024		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	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	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 3 al 7 de junio 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 Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez					
Vencimientos de Repo de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 3 al 7 de junio 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 3 al 7 de junio 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 3 al 7 de junio de 2024					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 500,1 4 000,0	3 500,0 4 800,0	4 000,0 4 700,0	4 000,0 4 156,3	2 000,1 3 800,0
Propuestas recibidas	3 530,2 4 152,0	5 248,3 4 807,3	5 526,5 4 787,9	4 226,4 4 156,3	4 758,5 4 389,3
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	5,55 5,50	5,48 5,59	5,50 5,60	5,53 5,60	5,50 5,50
Máxima	5,60 5,75	5,66 5,75	5,71 5,75	5,75 5,75	5,68 5,73
Promedio	5,60 5,67	5,61 5,67	5,64 5,71	5,68 5,72	5,64 5,64
Saldo	6 500,1	8 300,0	8 700,0	8 156,3	5 800,1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 31 de Mayo del 2024	6 500,1	8 300,0	8 700,0	8 156,3	5 800,1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 3 al 7 de junio de 2024	6 500,1	8 300,0	8 700,0	8 156,3	5 800,1
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300,0	300,0			300,0
Propuestas recibidas	816,0	854,4			900,0
Plazo de vencimiento	31 d	35 d			35 d
Tasas de interés: Mínima	6,08	6,10			6,13
Máxima	6,18	6,13			6,16
Promedio	6,13	6,11			6,15
Saldo	2 400,0	2 400,0	2 400,0	2 400,0	2 400,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 31 de Mayo del 2024	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 3 al 7 de junio de 2024	600,0	300,0	300,0	300,0	600,0
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 3 al 7 de junio 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 3 al 7 de junio 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 3 al 7 de junio 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 3 al 7 de junio 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 3 al 7 de junio 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 Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 3 al 7 de junio 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 Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 3 al 7 de junio de 2024					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		120,0 Desierta 40,0	400,0	325,0	400,0
Propuestas recibidas		310,0 -.- 140,0	435,0	335,0	580,0
Plazo de vencimiento		92 d 92 d 92 d	92 d	90 d	88 d
Tasas de interés: Mínima		6,00 - 6,15	6,15	6,13	6,22
Máxima		6,15 - 6,15	6,15	6,25	6,25
Promedio		6,09 - 6,15	6,15	6,14	6,23
Saldo	53 733,2	53 369,2	53 469,2	53 494,2	53 594,2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 31 de Mayo del 2024	524,0	300,0	300,0	300,0	640,0
Vencimiento de SC - Venta del 3 al 7 de junio de 2024	1 424,0	900,0	600,0	300,0	3 060,0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)					50,0
Propuestas recibidas					70,0
Plazo de vencimiento					6 d
Tasas de interés: Mínima					5,67
Máxima					6,02
Promedio					5,80
Saldo					50,0
Próximo vencimiento de RED					50,0
Vencimiento de RED del 3 al 7 de junio de 2024					50,0
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 3 al 7 de junio de 2024					
b. Liquid. Repos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)					
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$)	0,0	6,8	1,6	5,7	0,0
i. Compras (millones de US$)		6,8	1,6	5,7	
ii. Ventas (millones de US$)					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	31,2	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)			31,2		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3 306,4**	**2 386,9**	**1 833,9**	**2 037,2**	**3 024,1**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0174%	0,0174%	0,0174%	0,0174%	0,0174%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	701,5	653,0	243,0	1 004,0	1 555,1
Tasa de interés	3,50%	3,50%	3,50%	3,50%	3,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2 604,9**	**1 733,9**	**1 590,9**	**1 033,2**	**1 469,0**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 633,8	12 492,8	12 330,4	12 198,3	12 043,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,9	5,8	5,7	5,7	5,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 714,9	5 573,9	5 411,5	5 279,4	5 124,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,7	2,6	2,5	2,5	2,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	748,2	549,3	609,8	708,2	1 135,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	5,75 / 5,75 / 5,75	5,75 / 5,75 / 5,75	5,75 / 5,75 / 5,75	5,75 / 5,75 / 5,75	5,75 / 5,75 / 5,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	200,0	150,0	170,0	140,0	79,0
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$)	**May, 24 2024**	**May, 27 2024**	**May, 28 2024**	**May, 29 2024**	**May, 30 2024**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	55,0	22,9	-21,7	45,6	41,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	28,7	47,3	24,1	54,4	-14,8
a. Mercado spot con el público	25,1	60,8	0,8	67,8	1,9
i. Compras	414,0	342,7	713,7	663,5	635,7
ii. (-) Ventas	388,9	281,8	712,9	595,7	633,8
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-87,8	34,7	-0,7	6,3	84,8
i. Pactadas	106,8	58,1	190,2	496,5	395,6
ii. (-) Vencidas	194,7	23,4	190,9	490,2	310,8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-30,3	57,3	-47,3	36,5	38,4
i. Pactadas	434,6	105,5	479,2	638,5	525,8
ii. (-) Vencidas	464,9	48,2	526,5	602,0	487,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	299,2	184,7	350,1	432,0	630,6
ii. A futuro	0,0	90,0	60,0	140,0	162,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	270,8	10,5	353,8	94,6	165,8
i. Compras	449,3	30,8	519,0	583,0	471,5
ii. (-) Ventas	178,5	20,3	165,2	488,4	305,8
f. Efecto de Opciones	3,5	-1,8	3,1	-5,6	3,8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	83,5	0,7	-90,4	30,8	0,5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera

Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,7351	3,7411	3,7462	3,7598	3,7480
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera