BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	03 Jun 24			04 Jun 24			05 Jun 24			06 Jun 24		
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 136,0**			**8 239,9**			**9 391,4**			**7 559,4**		
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)												
Propuestas recibidas												
Plazo de vencimiento												
Tasas de interés: Mínima												
Máxima												
Promedio												
Saldo	35 230,6			35 230,6			35 230,6			35 230,6		
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Junio del 2024	1 350,0			1 350,0			1 350,0			1 350,0		
Vencimiento de CD BCRP del 10 al 14 de junio de 2024										1 350,0		
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2500,0	300,0	2700,0	1500,0	300,0	2600,0	1000,0	1600,0		1000,0	300,0	800,0
Propuestas recibidas	2570,0	900,0	5400,0	3000,0	850,0	4700,0	2000,0	3200,0		2000,0	700,0	800,0
Plazo de vencimiento	1 d	30 d	1 d	1 d	30 d	1 d	1 d	1 d		4 d	92 d	4 d
Tasas de interés: Mínima	5,75	5,86	5,86	5,81	5,88	5,82	5,86	5,86		5,86	5,86	5,76
Máxima	5,81	6,06	5,86	5,86	5,96	5,89	5,88	5,93		5,89	6,03	5,81
Promedio	5,78	5,94	5,86	5,83	5,92	5,86	5,87	5,90		5,88	5,93	5,79
Saldo	14 506,5			13 706,5			12 856,5			13 756,5		
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 10 de Junio del 2024	5 200,0			4 100,0			2 900,0			1 800,0		
Vencimiento de Repo Valores del 10 al 14 de junio de 2024	5 500,0			4 400,0			2 900,0			2 100,0		
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 10 al 14 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		
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 11 de Julio del 2024	2,5			2,5			2,5			2,5		
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 10 al 14 de junio 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	53 399,9			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		
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 10 al 14 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 10 al 14 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 10 al 14 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 10 al 14 de junio de 2024												
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)												
Propuestas recibidas												
Plazo de vencimiento												
Tasas de interés: Mínima												
Máxima												
Promedio												
Saldo												
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo												
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 10 al 14 de junio de 2024												
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					300,0						300,0	
Propuestas recibidas					955,0						905,0	
Plazo de vencimiento					35 d						36 d	
Tasas de interés: Mínima					6,16						6,03	
Máxima					6,16						6,16	
Promedio					6,16						6,08	
Saldo	2 400,0				2 400,0			2 400,0			2 400,0	
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 11 de Junio del 2024	300,0				300,0			300,0			300,0	
Vencimiento de Coloc-TP del 10 al 14 de junio de 2024	600,0				300,0			300,0			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 10 al 14 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 10 al 14 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 10 al 14 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 10 al 14 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 10 al 14 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 10 al 14 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 10 al 14 de junio de 2024												
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	287,0	110,0		200,0	Desierta	300,0	300,0	200,0		500,0	230,0	200,0		420,0	Desierta	Desierta	18,0
Propuestas recibidas	377,0	210,0		265,0	-.-	550,0	625,0	470,0		539,8	230,0	310,0		420,0	-.-	-.-	33,0
Plazo de vencimiento	92 d	183 d		92 d	183 d	92 d	93 d	93 d		97 d	183 d	96 d		97 d	183 d	273 d	183 d
Tasas de interés: Mínima	6,14	5,80		6,25	-	6,04	6,04	6,13		6,18	5,77	6,17		6,24	-	-	5,80
Máxima	6,25	5,85		6,25	-	6,24	6,22	6,19		6,25	5,85	6,24		6,25	-	-	5,80
Promedio	6,23	5,80		6,25	-	6,13	6,14	6,16		6,22	5,80	6,21		6,25	-	-	5,80
Saldo	53 351,2			53 581,2						53 711,2				53 299,2			
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de Junio del 2024	770,0			800,0						850,0				800,0			
Vencimiento de SC - Venta del 10 al 14 de junio de 2024	2 420,0			1 650,0						850,0				1 200,0			
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)	100,0			50,0						50,0							
Propuestas recibidas	170,0			100,0						80,0							
Plazo de vencimiento	7 d			7 d						7 d							
Tasas de interés: Mínima	5,86			5,78						5,71							
Máxima	5,86			5,96						5,95							
Promedio	5,86			5,89						5,81							
Saldo	150,0			200,0						250,0				200,0			
Próximo vencimiento de RED el 10 de Junio del 2024	50,0			50,0						50,0				100,0			
Vencimiento de RED del 10 al 14 de junio de 2024	50,0			50,0						50,0				200,0			
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 10 al 14 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			
i. Compras (millones de US$)	0,0			0,0						0,0				0,0			
Tipo de cambio promedio	0,0			0,0						0,0				0,0			
ii. Ventas (millones de US$)	0,0			0,0						0,0				0,0			
Tipo de cambio promedio	0,0			0,0						0,0				0,0			
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0,0			2,2						0,3				0,0			
i. Compras (millones de US$)				2,2						0,3							
ii. Ventas (millones de US$)																	
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	27,1			0,0						31,5				0,0			
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR																	
ii. Compras de BTP (Valorizado)	27,1									31,5							
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**13 636,0**			**12 939,9**						**12 642,0**				**11 659,4**			
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones																	
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).																	
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0175%			0,0175%						0,0174%				0,0174%			
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0			0,0						0,0				0,0			
Tasa de interés																	
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional																	
Tasa de interés																	
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	50,0			100,0						571,0				1 854,9			
Tasa de interés	3,50%			3,50%						3,50%				3,50%			
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**13 586,0**			**12 839,9**						**12 071,0**				**9 804,5**			
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	11 733,6			14 330,5						15 243,8				15 720,7			
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,5			6,6						7,1				7,3			
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 814,7			7 527,5						8 440,7				8 917,6			
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,2			3,5						3,9				4,1			
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP																	
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 481,9			1 436,0						1 384,0				1 611,7			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	5,75 / 5,75 / 5,75			5,75 / 5,75 / 5,75						5,75 / 5,75 / 5,75				5,50 / 5,75 / 5,74			
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	80,0			119,0						113,0				168,0			
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5,50 / 5,50 / 5,50			5,50 / 5,80 / 5,52						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, 31 2024**			**Jun, 03 2024**						**Jun, 04 2024**				**Jun, 05 2024**			
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-33,2			-33,2						-72,2				38,9			
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-38,2			-14,7						48,0				33,8			
a. Mercado spot con el público	-27,2			-10,3						51,9				79,3			
i. Compras	1175,2			627,6						526,0				534,5			
ii. (-) Ventas	1202,4			637,9						474,1				455,3			
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	103,5			-194,1						82,4				-76,7			
i. Pactadas	170,5			91,5						225,9				436,9			
ii. (-) Vencidas	67,0			285,6						143,5				513,6			
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	129,5			-239,1						261,8				-57,2			
i. Pactadas	397,7			371,0						804,9				842,3			
ii. (-) Vencidas	268,2			610,1						543,1				899,5			
d. Operaciones cambiarias interbancarias																	
i. Al contado	499,8			427,6						357,4				544,1			
ii. A futuro	120,0			45,0						270,0				130,0			
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	197,8			322,6						396,2				382,6			
i. Compras	264,2			581,8						539,7				890,7			
ii. (-) Ventas	66,4			259,1						143,5				508,2			
f. Efecto de Opciones	3,6			3,7						-2,0				-11,0			
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	19,8			-69,7						60,7				-6,4			
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)	3,7373	3,7293	3,7398	3,7465
(*) Datos preliminares				

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera