BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	10 Jun 24	11 Jun 24	12 Jun 24	13 Jun 24	14 Jun 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**11 918,0**	**11 019,0**	**11 619,1**	**11 783,8**	**11 579,5**
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)					300,0 200,0
Propuestas recibidas					1115,0 701,8
Plazo de vencimiento					91 d 185 d
Tasas de interés: Mínima					5,46 5,20
Máxima					5,47 5,25
Promedio					5,46 5,22
Saldo	35 230,6	35 230,6	35 230,6	35 230,6	34 647,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 19 de Junio del 2024	1 350,0	1 350,0	1 350,0	1 350,0	1 896,0
Vencimiento de CD BCRP del 17 al 21 de junio de 2024	1 350,0	1 350,0	1 350,0	1 350,0	1 896,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					150,0
Propuestas recibidas					600,0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					5,76
Máxima					5,82
Promedio					5,79
Saldo	11 956,5	11 956,5	12 456,5	12 456,5	12 495,5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de Junio del 2024	300,0	300,0	300,0	300,0	500,0
Vencimiento de Repo Valores del 17 al 21 de junio de 2024	300,0	300,0	300,0	300,0	500,0
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 17 al 21 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 17 al 21 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	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 17 al 21 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 17 al 21 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 17 al 21 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 17 al 21 de junio de 2024					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	300,0 2 300,0	1 500,0 2 800,0	3 000,0 2 300,0	4 000,0 4 700,0	5 000,0 3 800,0
Propuestas recibidas	1 253,1 4 811,1	4 821,9 5 380,1	6 514,5 5 064,8	7 423,1 5 222,2	8 237,7 4 256,1
Plazo de vencimiento	7 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	5,05 5,35	5,43 5,30	5,10 5,00	5,14 5,00	3,69 5,04
Máxima	5,60 5,57	5,55 5,31	5,47 5,36	5,32 5,72	5,57 5,71
Promedio	5,55 5,53	5,50 5,31	5,38 5,29	5,26 5,28	5,41 5,54
Saldo	2 600,0	4 600,0	5 600,0	9 000,0	9 100,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de Junio del 2024	2 300,0	4 300,0	5 300,0	8 700,0	9 100,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 17 al 21 de junio de 2024	2 300,0	4 300,0	5 300,0	8 700,0	9 100,0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)		300,0		100,0	300,0
Propuestas recibidas		890,0		900,0	910,0
Plazo de vencimiento		35 d		36 d	33 d
Tasas de interés: Mínima		5,86		5,81	5,81
Máxima		6,03		5,86	5,88
Promedio		5,95		5,84	5,85
Saldo	2 400,0	2 400,0	2 400,0	2 200,0	2 200,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Junio del 2024	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 17 al 21 de junio de 2024	900,0	600,0	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 17 al 21 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 17 al 21 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 17 al 21 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 17 al 21 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 17 al 21 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 17 al 21 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 17 al 21 de junio de 2024					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	400,0 Desierta 100,0 300,0 90,0		400,0 300,0		300,0 200,0
Propuestas recibidas	665,0 -.- 250,0 511,0 140,0		1232,0 826,0		530,0 660,0
Plazo de vencimiento	94 d 273 d 365 d 93 d 94 d		96 d 97 d		95 d 90 d
Tasas de interés: Mínima	6,19 - 5,35 6,15 6,22		5,33 5,55		6,19 5,40
Máxima	6,23 - 5,35 6,22 6,24		5,69 5,95		6,24 5,89
Promedio	6,22 - 5,35 6,20 6,23		5,44 5,73		6,22 5,64
Saldo	53 389,2	53 389,2	54 089,2	54 089,2	54 189,2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 18 de Junio del 2024	400,0	400,0	400,0	400,0	400,0
Vencimiento de SC - Venta del 17 al 21 de junio de 2024	400,0	400,0	400,0	400,0	1 300,0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	100,0	50,0			
Próximo vencimiento de RED	50,0	50,0			
Vencimiento de RED del 17 al 21 de junio de 2024	100,0	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 17 al 21 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$)	0,0	1,2	6,5	0,0	8,4
i. Compras (millones de US$)		1,2	6,5		8,4
ii. Ventas (millones de US$)					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	29,6	0,0	31,4	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	29,6		31,4		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**9 631,9**	**7 979,0**	**8 249,8**	**4 987,0**	**4 909,0**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0174%	0,0174%	0,0174%	0,0173%	0,0173%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 049,5	717,8	732,3	45,3	485,0
Tasa de interés	3,50%	3,50%	3,50%	3,50%	3,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**8 582,4**	**7 261,2**	**7 517,5**	**4 941,7**	**4 424,0**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	15 523,6	15 633,7	15 449,9	15 380,8	14 935,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,2	7,2	7,1	7,1	6,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 720,6	8 892,5	8 646,5	8 579,3	8 135,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,0	4,1	4,0	3,9	3,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 035,5	611,0	1 100,0	942,5	953,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	5,75 / 5,75 / 5,75	5,75 / 5,80 / 5,75	5,75 / 5,75 / 5,75	5,50 / 5,75 / 5,72	5,75 / 5,75 / 5,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	150,0	140,0	97,0	132,0	77,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5,50 / 5,50 / 5,50	5,50 / 5,50 / 5,50	5,50 / 5,50 / 5,50	5,45 / 5,60 / 5,52	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$)	**Jun, 06 2024**	**Jun, 10 2024**	**Jun, 11 2024**	**Jun, 12 2024**	**Jun, 13 2024**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-59,3	125,2	-1,7	-193,7	-30,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-50,5	-95,9	80,7	-968,7	74,6
a. Mercado spot con el público	9,0	-48,4	80,1	-962,2	84,0
i. Compras	641,2	931,1	743,6	832,5	642,2
ii. (-) Ventas	632,2	979,5	663,5	1794,7	558,2
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	133,9	144,5	-130,3	211,2	57,6
i. Pactadas	209,9	186,5	180,0	436,1	548,6
ii. (-) Vencidas	76,0	42,0	310,4	224,9	491,0
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	29,5	-63,2	-51,8	-377,0	159,3
i. Pactadas	489,7	518,9	389,6	309,2	731,9
ii. (-) Vencidas	460,1	582,1	441,4	686,2	572,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	429,9	346,1	389,1	1119,7	366,4
ii. A futuro	10,0	95,0	205,0	250,0	125,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	323,3	483,3	128,2	449,5	84,6
i. Compras	370,4	518,6	427,9	673,2	558,5
ii. (-) Ventas	47,1	35,3	299,7	223,7	473,9
f. Efecto de Opciones	-3,4	-7,3	-3,8	0,9	-3,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-108,4	29,9	3,3	191,1	-12,4
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)	3,7532	3,7797	3,7845	3,7685	3,7758
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera