BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	01 Jul 24	02 Jul 24	03 Jul 24	04 Jul 24	05 Jul 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**14 462,2**	**14 938,9**	**15 180,9**	**15 785,3**	**13 696,0**
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)			100,0	100,0 50,0	200,0 50,0
Propuestas recibidas			308,2	582,0 200,0	765,5 140,0
Plazo de vencimiento			184 d	92 d 274 d	91 d 367 d
Tasas de interés: Mínima			5,21	5,38 5,00	5,34 4,98
Máxima			5,24	5,39 5,06	5,38 5,00
Promedio			5,22	5,39 5,04	5,37 5,00
Saldo	36 061,6	36 061,6	36 161,6	36 311,6	36 686,6
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Julio del 2024	1 488,9	1 488,9	1 488,9	1 488,9	1 488,9
Vencimiento de CD BCRP del 8 al 12 de julio de 2024					1 488,9
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					300,0
Propuestas recibidas					500,0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					5,71
Máxima					5,80
Promedio					5,76
Saldo	15 055,5	15 055,5	15 155,5	14 855,5	14 855,5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 12 de Julio del 2024	300,0	300,0	300,0	300,0	500,0
Vencimiento de Repo Valores del 8 al 12 de julio de 2024	900,0	900,0	600,0	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 8 al 12 de julio 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 8 al 12 de julio de 2024					2,5
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 8 al 12 de julio 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 8 al 12 de julio 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 8 al 12 de julio 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 8 al 12 de julio de 2024					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)		1 000,0	999,9 1 500,0	2 000,0 3 750,0	3 000,0 2 850,0
Propuestas recibidas		4 551,3	4 434,1 3 786,9	5 066,8 4 874,6	5 165,3 4 711,5
Plazo de vencimiento		1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima		4,97	5,20 5,00	5,00 5,00	5,08 5,00
Máxima		5,45	5,30 5,15	5,21 5,68	5,50 5,48
Promedio		5,36	5,26 5,11	5,16 5,31	5,35 5,28
Saldo		1 000,0	2 499,9	5 750,0	5 850,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 8 de Julio del 2024		1 000,0	2 499,9	5 750,0	5 850,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 8 al 12 de julio de 2024		1 000,0	2 499,9	5 750,0	5 850,0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)		300,0		300,0	154,0
Propuestas recibidas		614,0		600,0	604,0
Plazo de vencimiento		31 d		92 d	35 d
Tasas de interés: Mínima		5,81		5,81	5,80
Máxima		5,88		5,83	5,86
Promedio		5,85		5,82	5,81
Saldo	1 900,0	1 900,0	1 900,0	2 200,0	2 054,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 9 de Julio del 2024	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 8 al 12 de julio 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 8 al 12 de julio 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 8 al 12 de julio 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 8 al 12 de julio 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 8 al 12 de julio 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 8 al 12 de julio 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 8 al 12 de julio 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 8 al 12 de julio de 2024					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	400,0 40,0 225,0		499,9 200,0 300,0		19,0 200,0 190,0
Propuestas recibidas	772,5 140,0 273,5		1008,0 600,0 858,0		424,0 600,0 220,0
Plazo de vencimiento	86 d 185 d 85 d		99 d 183 d 89 d		90 d 185 d 181 d
Tasas de interés: Mínima	5,95 5,70 6,07		6,08 5,69 5,55		5,96 5,55 5,64
Máxima	6,09 5,75 6,09		6,09 5,72 5,86		5,96 5,64 5,64
Promedio	6,03 5,73 6,09		6,08 5,70 5,73		5,96 5,57 5,64
Saldo	56 134,2	56 134,2	56 434,1	56 434,1	56 243,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 8 de Julio del 2024	700,0	700,0	600,0	600,0	200,0
Vencimiento de SC - Venta del 8 al 12 de julio de 2024	1 300,0	1 300,0	600,0	600,0	1 800,0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)			50,0		
Propuestas recibidas			70,0		
Plazo de vencimiento			7 d		
Tasas de interés: Mínima			5,80		
Máxima			5,94		
Promedio			5,88		
Saldo	100,0	100,0	150,0	150,0	150,0
Próximo vencimiento de RED el 10 de Julio del 2024	100,0	100,0	50,0	50,0	50,0
Vencimiento de RED del 8 al 12 de julio 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 8 al 12 de julio 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$)	3,3	2,7	0,6	0,2	0,0
i. Compras (millones de US$)	3,3	2,7	0,6	0,2	0,0
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	31,6	0,0	24,9	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	31,6		24,9		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**15 342,2**	**14 443,7**	**13 781,2**	**11 471,2**	**9 432,1**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0172%	0,0172%	0,0172%	0,0172%	0,0172%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	120,0	72,8	426,6	46,1
Tasa de interés	3,50%	3,50%	3,50%	3,50%	3,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**15 342,2**	**14 323,7**	**13 708,4**	**11 044,6**	**9 386,0**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 058,6	21 990,7	21 990,7	20 919,2	19 741,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,5	10,0	10,0	9,5	9,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 277,2	15 342,2	15 342,2	14 270,7	13 092,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,4	7,0	7,0	6,5	5,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 193,5	1 214,0	1 196,0	788,0	1 040,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	5,75 / 5,75 / 5,75	5,75 / 5,75 / 5,75	5,75 / 5,75 / 5,75	5,75 / 5,75 / 5,75	5,75 / 5,75 / 5,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	65,0	32,0	57,0	67,0	103,0
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$)	**Jun, 28 2024**	**Jul, 01 2024**	**Jul, 02 2024**	**Jul, 03 2024**	**Jul, 04 2024**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-72,6	1,9	64,3	53,2	-14,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	173,1	51,3	65,1	-113,1	96,2
a. Mercado spot con el público	193,1	89,1	86,5	-76,6	112,9
i. Compras	1597,6	463,9	763,4	715,2	340,7
ii. (-) Ventas	1404,5	374,7	676,8	791,9	227,8
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	13,8	-218,2	21,6	-202,4	-12,0
i. Pactadas	207,2	119,6	238,2	184,0	2,7
ii. (-) Vencidas	193,4	337,8	216,6	386,4	14,7
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	278,7	-160,2	8,6	-284,8	100,0
i. Pactadas	788,7	510,9	445,1	277,4	138,3
ii. (-) Vencidas	510,0	671,1	436,5	562,2	38,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	324,1	317,1	483,9	574,6	171,9
ii. A futuro	108,0	68,0	83,0	170,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	298,6	303,5	219,0	135,1	19,2
i. Compras	488,4	638,5	433,5	521,1	33,7
ii. (-) Ventas	189,9	335,0	214,4	386,1	14,4
f. Efecto de Opciones	-3,1	-3,2	-13,8	11,6	1,7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	20,4	3,7	-20,6	76,6	-12,2
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)	3,8347	3,8474	3,8269	3,7967	3,7952
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera