BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	22 Jul 24			24 Jul 24			25 Jul 24		
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**9 060,5**			**10 267,2**			**7 282,1**		
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	50,0							
Propuestas recibidas	505,0	100,0							
Plazo de vencimiento	91 d	368 d							
Tasas de interés: Mínima	5,34	4,98							
Máxima	5,37	4,98							
Promedio	5,36	4,98							
Saldo	37 967,5			37 238,9			37 238,9		
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Agosto del 2024	227,5			1 516,1			1 516,1		
Vencimiento de CD BCRP del 30 de julio al 2 de agosto de 2024	728,6								
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)							200,0		
Propuestas recibidas							600,0		
Plazo de vencimiento							92 d		
Tasas de interés: Mínima							5,71		
Máxima							5,72		
Promedio							5,72		
Saldo	15 754,4			15 754,4			15 654,4		
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 2 de Agosto del 2024	300,0			300,0			300,0		
Vencimiento de Repo Valores del 30 de julio al 2 de agosto de 2024	300,0			300,0			300,0		
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 30 de julio al 2 de agosto de 2024									
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento									
Tasas de interés: Mínima									
Máxima									
Promedio									
Saldo	6 204,7			6 204,7			6 204,7		
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 12 de Agosto del 2024	50,0			50,0			50,0		
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 30 de julio al 2 de agosto 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		
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		
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 30 de julio al 2 de agosto 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 30 de julio al 2 de agosto 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 30 de julio al 2 de agosto 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 30 de julio al 2 de agosto de 2024									
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 999,9	700,0	3050,0	4 000,0	500,0	4000,0	4 500,0	2 900,0	
Propuestas recibidas	5 400,0	1 661,8	3581,5	6 221,0	1 543,7	4890,4	5 685,0	2 981,9	
Plazo de vencimiento	2 d	8 d	2 d	1 d	7 d	1 d	5 d	5 d	
Tasas de interés: Mínima	5,49	5,45	5,40	5,47	5,41	5,46	5,43	5,41	
Máxima	5,58	5,51	5,56	5,57	5,55	5,55	5,58	5,55	
Promedio	5,56	5,51	5,50	5,53	5,50	5,51	5,52	5,50	
Saldo		9 549,9			10 000,0			8 600,0	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 30 de Julio del 2024		8 049,9			8 800,0			8 100,0	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 30 de julio al 2 de agosto de 2024		8 849,9			8 800,0			8 600,0	
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento									
Tasas de interés: Mínima									
Máxima									
Promedio									
Saldo		1 019,0			1 019,0			1 019,0	
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 2 de Agosto del 2024		300,0			300,0			300,0	
Vencimiento de Coloc-TP del 30 de julio al 2 de agosto de 2024								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 30 de julio al 2 de agosto 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 30 de julio al 2 de agosto 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 30 de julio al 2 de agosto 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 30 de julio al 2 de agosto 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 30 de julio al 2 de agosto 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 30 de julio al 2 de agosto 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 30 de julio al 2 de agosto de 2024									
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	332,5	300,0	137,0	77,5	300,0	300,0	200,0	400,0	200,0	200,0
Propuestas recibidas	732,5	330,0	187,0	107,5	942,0	350,0	460,0	830,0	200,0	360,0
Plazo de vencimiento	87 d	184 d	365 d	365 d	86 d	181 d	365 d	88 d	182 d	364 d
Tasas de interés: Mínima	5,87	5,57	5,20	5,19	5,69	5,55	5,15	5,95	5,60	5,17
Máxima	6,00	5,59	5,20	5,20	5,94	5,58	5,18	6,00	5,63	5,20
Promedio	5,96	5,58	5,20	5,20	5,84	5,56	5,17	5,97	5,62	5,19
Saldo		55 088,0				54 838,1			54 838,1	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de Julio del 2024		300,0				800,0			700,0	
Vencimiento de SC - Venta del 30 de julio al 2 de agosto de 2024		1 849,9				800,0			2 355,0	
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo		130,0				130,0			130,0	
Próximo vencimiento de RED el 30 de Julio del 2024		100,0				100,0			100,0	
Vencimiento de RED del 30 de julio al 2 de agosto de 2024									100,0	
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 30 de julio al 2 de agosto 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	
i. Compras (millones de US$)		0,0				0,0			0,0	
Tipo de cambio promedio		0,0				0,0			0,0	
ii. Ventas (millones de US$)		0,0				0,0			0,0	
Tipo de cambio promedio		0,0				0,0			0,0	
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)		1,1				12,7			17,0	
i. Compras (millones de US$)		1,1				12,7			17,0	
ii. Ventas (millones de US$)		0,0				0,0			0,0	
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP		62,0				55,2			0,0	
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP (Valorizado)		62,0				55,2				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones		**3 581,5**				**3 612,7**			**1 769,3**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).										
Comisión (tasa efectiva diaria)		0,0175%				0,0169%			0,0173%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)		0,0				0,0			0,0	
Tasa de interés										
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional		584,2				534,2			197,2	
Tasa de interés		3,50%				3,50%			3,50%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones		**2 997,3**				**3 078,5**			**1 572,1**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)		13 718,1				13 564,6			13 257,0	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)		6,2				6,1			6,0	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)		7 100,6				6 923,6			6 616,0	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)		3,2				3,1			3,0	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional		735,0				344,0			1 033,0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO		5,10 / 5,75 / 5,74				5,00 / 5,75 / 5,59			5,75 / 5,75 / 5,75	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)		130,0				120,0			155,0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio		5,50 / 5,50 / 5,50				5,50 / 5,50 / 5,50			5,50 / 5,50 / 5,50	
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$)	**Jul, 19 2024**			**Jul, 22 2024**			**Jul, 24 2024**		
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	13,2			18,4			84,0		
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	4,2			-12,7			221,3		
a. Mercado spot con el público	6,4			2,8			218,4		
i. Compras	533,5			1033,2			670,9		
ii. (-) Ventas	527,1			1030,4			452,5		
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-178,3			95,9			-101,9		
i. Pactadas	221,1			285,3			107,6		
ii. (-) Vencidas	399,5			189,3			209,5		
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-189,1			38,8			47,3		
i. Pactadas	518,0			617,7			778,4		
ii. (-) Vencidas	707,1			578,9			731,1		
d. Operaciones cambiarias interbancarias									
i. Al contado	302,3			349,9			433,4		
ii. A futuro	20,0			110,0			280,0		
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	303,1			380,1			527,2		
i. Compras	697,1			556,3			723,1		
ii. (-) Ventas	394,0			176,2			195,9		
f. Efecto de Opciones	-1,7			-2,0			-0,2		
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	2,3			-30,1			9,3		
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)	3,7444	3,7547	3,7755
(*) Datos preliminares			

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera