BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	09 Set 24	10 Set 24	11 Set 24	12 Set 24	13 Set 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**10 890,0**	**9 620,4**	**10 894,4**	**10 740,4**	**9 407,6**
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	200,1 200,0	30,0 300,0	300,0	200,0 300,0
Propuestas recibidas	558,3 606,6	823,6 616,7	150,5 978,0	587,3	793,8 553,9
Plazo de vencimiento	267 d 92 d	360 d 185 d	546 d 359 d	264 d	357 d 95 d
Tasas de interés: Mínima	4,77 4,87	4,68 4,80	4,62 4,66	4,76	4,56 4,67
Máxima	4,83 5,08	4,74 4,85	4,64 4,70	4,78	4,66 5,03
Promedio	4,80 5,04	4,72 4,84	4,63 4,68	4,78	4,65 5,02
Saldo	39 916,4	39 916,5	38 346,0	38 796,0	38 036,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de Setiembre del 2024	400,0	2 065,5	1 510,0	1 510,0	1 958,0
Vencimiento de CD BCRP del 16 al 20 de setiembre de 2024	3 975,5	3 575,5	1 510,0	1 510,0	5 138,3
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)		500,0			500,0
Propuestas recibidas		500,0			1500,0
Plazo de vencimiento		30 d			91 d
Tasas de interés: Mínima		5,55			5,30
Máxima		5,55			5,30
Promedio		5,55			5,30
Saldo	15 104,5	14 854,5	14 854,5	14 665,5	14 015,5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 16 de Setiembre del 2024	750,0	189,0	189,0	1 150,0	900,0
Vencimiento de Repo Valores del 16 al 20 de setiembre de 2024	2 089,0	1 339,0	1 339,0	1 150,0	1 200,0
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 16 al 20 de setiembre de 2024					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 728,1	5 728,1	5 728,1	5 728,1	5 728,1
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo	561,9	561,9	561,9	561,9	561,9
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 16 al 20 de setiembre de 2024	0,0				561,9
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 16 al 20 de setiembre 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 16 al 20 de setiembre 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 16 al 20 de setiembre 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 16 al 20 de setiembre de 2024					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 000,0 1 000,0 2000,0	2 000,0 1 000,0 1600,0	2 999,9 999,9 2300,0	3 000,1 1 000,0 2900,0	3 500,0 1 000,0 2100,0
Propuestas recibidas	4 484,9 2 612,0 4478,4	4 232,9 1 984,0 3854,5	5 161,0 2 656,2 3761,5	6 446,0 2 930,8 4502,9	6 467,6 2 360,5 3223,7
Plazo de vencimiento	1 d 7 d 1 d	1 d 7 d 1 d	1 d 7 d 1 d	1 d 7 d 1 d	3 d 7 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	5,00 4,90 4,86	4,95 5,00 4,97	4,95 5,00 4,99	5,02 5,00 4,93	4,85 5,00 4,90
Máxima	5,00 5,20 5,18	5,14 5,18 5,05	5,15 5,15 5,12	5,16 5,11 5,12	5,12 5,11 5,08
Promedio	5,00 5,14 5,02	5,02 5,14 5,02	5,06 5,12 5,05	5,12 5,11 5,08	5,08 5,10 5,06
Saldo	6 500,0	8 100,0	10 299,8	10 900,0	10 599,9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 16 de Setiembre del 2024	3 000,0	4 100,0	6 299,9	6 900,1	6 600,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 16 al 20 de setiembre de 2024	5 500,0	6 100,0	7 299,9	6 900,1	10 599,9
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 4 de Octubre del 2024	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 16 al 20 de setiembre de 2024					
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 16 al 20 de setiembre 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 16 al 20 de setiembre 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 16 al 20 de setiembre 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 16 al 20 de setiembre 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 16 al 20 de setiembre 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 16 al 20 de setiembre 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 16 al 20 de setiembre de 2024					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	400,0 200,0 200,0	400,0 300,0	114,0 245,0	170,0 105,0 190,0 200,0	400,1 300,0
Propuestas recibidas	991,0 398,0 561,0	571,0 340,0	354,0 245,0	490,0 105,0 220,0 417,0	739,0 340,0
Plazo de vencimiento	92 d 182 d 92 d	92 d 181 d	92 d 181 d	91 d 181 d 91 d 91 d	91 d 181 d
Tasas de interés: Mínima	5,44 5,17 5,44	5,41 5,13	5,49 5,17	5,49 5,19 5,52 5,17	5,44 5,07
Máxima	5,57 5,17 5,49	5,52 5,23	5,51 5,22	5,54 5,20 5,55 5,39	5,53 5,15
Promedio	5,53 5,17 5,46	5,45 5,17	5,50 5,20	5,51 5,19 5,54 5,25	5,48 5,11
Saldo	53 590,5	53 790,5	53 429,5	53 404,5	53 434,6
Próximo vencimiento de SC-Venta el 16 de Setiembre del 2024	500,0	720,0	690,0	670,0	700,0
Vencimiento de SC - Venta del 16 al 20 de setiembre de 2024	2 580,0	2 080,0	1 360,0	670,0	3 400,0
xxi. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de RED					
Vencimiento de RED del 16 al 20 de setiembre de 2024					
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 16 al 20 de setiembre 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$)	0,5	0,0	0,3	1,9	7,4
i. Compras (millones de US$)	0,5	0,0	0,3	1,9	7,4
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	26,3	0,0	56,4	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	26,3		56,4		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**8 005,1**	**6 717,7**	**5 942,4**	**5 180,8**	**4 616,0**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0172%	0,0172%	0,0172%	0,0172%	0,0162%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	26,0	470,0	40,0	354,0	177,0
Tasa de interés	3,50%	3,50%	3,50%	3,50%	3,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**7 979,1**	**6 247,7**	**5 902,4**	**4 826,8**	**4 439,0**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	17 136,1	16 771,3	16 309,6	16 015,3	15 591,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,5	7,4	7,2	7,0	6,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	9 921,6	9 557,1	9 098,8	8 803,7	8 415,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,4	4,2	4,0	3,9	3,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 151,0	626,2	955,0	230,0	1 188,4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	5,35 / 5,50 / 5,48	5,05 / 5,50 / 5,40	5,50 / 5,50 / 5,50	5,10 / 5,50 / 5,35	5,25 / 5,25 / 5,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	105,0	90,0	65,0	110,0	99,0
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$)	**Set.06 2024**	**Set.09 2024**	**Set.10 2024**	**Set.11 2024**	**Set.12 2024**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	60,2	-19,1	-51,1	-168,3	258,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	475,8	91,2	-163,0	-256,3	256,7
a. Mercado spot con el público	478,2	109,1	-158,4	-256,2	284,3
i. Compras	1079,3	641,9	583,5	382,7	1042,7
ii. (-) Ventas	601,1	532,8	741,9	638,8	758,4
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-12,2	159,2	-96,8	-0,9	129,4
i. Pactadas	75,1	208,3	188,1	192,1	520,9
ii. (-) Vencidas	87,3	49,0	284,9	192,9	391,5
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	431,3	320,4	-164,9	-177,2	127,6
i. Pactadas	810,2	639,5	458,1	1067,2	918,9
ii. (-) Vencidas	378,9	319,1	623,0	1244,4	791,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	525,0	370,9	245,7	199,8	675,9
ii. A futuro	101,0	201,0	5,0	130,0	130,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	287,4	248,7	333,0	1054,1	376,1
i. Compras	372,5	289,2	613,7	1243,3	764,8
ii. (-) Ventas	85,1	40,4	280,8	189,2	388,7
f. Efecto de Opciones	3,6	-6,5	-6,1	8,1	5,8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	26,1	60,8	50,4	-99,2	-10,1
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)	3,7969	3,8135	3,8188	3,7858	3,7671
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera