BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	30 Set 24	01 Oct 24	02 Oct 24	03 Oct 24	04 Oct 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**6 637,6**	**8 064,3**	**9 001,4**	**9 513,1**	**5 579,1**
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)		50,0	50,0		
Propuestas recibidas		181,3	150,0		
Plazo de vencimiento		364 d	539 d		
Tasas de interés: Mínima		4,50	4,35		
Máxima		4,52	4,35		
Promedio		4,50	4,35		
Saldo	37 050,5	37 101,8	37 151,8	37 151,8	36 751,8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de Octubre del 2024	400,0	400,0	400,0	400,0	1 742,0
Vencimiento de CD BCRP del 7 al 11 de octubre de 2024	400,0	400,0	400,0	400,0	1 742,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)		3500,0 1200,0	2600,0	2 200,0	1000,0 600,0 1500,0
Propuestas recibidas		4210,0 1850,0	2700,0	2 200,0	1150,0 1200,0 1500,0
Plazo de vencimiento		1 d 1 d	1 d	1 d	3 d 91 d 3 d
Tasas de interés: Mínima		5,25 5,31	5,38	5,25	5,25 5,30 5,26
Máxima		5,30 5,35	5,41	5,34	5,34 5,38 5,29
Promedio		5,28 5,33	5,40	5,29	5,28 5,35 5,28
Saldo	12 460,5	16 960,5	14 060,5	14 060,5	13 160,5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 7 de Octubre del 2024	400,0	4 700,0	3 250,0	4 000,0	3 200,0
Vencimiento de Repo Valores del 7 al 11 de octubre de 2024	2 850,0	7 150,0	5 050,0	4 000,0	4 000,0
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 7 al 11 de octubre de 2024					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 018,5	5 018,5	5 018,5	4 818,8	4 818,8
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 10 de Octubre del 2024	199,7	199,7	199,7	199,6	199,6
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 7 al 11 de octubre de 2024	199,7	199,7	199,7		199,6
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 7 al 11 de octubre 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 7 al 11 de octubre 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 7 al 11 de octubre 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 7 al 11 de octubre de 2024					
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 701,0 3 090,6	500,0	499,9	1 000,0	500,0
Propuestas recibidas	2 701,0 3 090,6	2 567,5	2 547,5	2 208,0	1 330,5
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	8 d	7 d	7 d	7 d
Tasas de interés: Mínima	5,05 4,96	4,89	4,90	4,90	4,90
Máxima	5,25 5,25	5,08	5,00	4,98	4,97
Promedio	5,16 5,13	5,02	4,99	4,97	4,95
Saldo	8 291,7	2 000,1	1 999,9	1 999,9	2 499,9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 9 de Octubre del 2024	6 791,6	500,1	1 000,0	999,9	999,9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 7 al 11 de octubre de 2024	8 291,7	1 500,1	1 000,0		2 499,9
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					300,0
Propuestas recibidas					960,0
Plazo de vencimiento					32 d
Tasas de interés: Mínima					5,26
Máxima					5,30
Promedio					5,28
Saldo	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 31 de Octubre del 2024	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 7 al 11 de octubre de 2024	300,0	300,0	300,0	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 7 al 11 de octubre 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 7 al 11 de octubre 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 7 al 11 de octubre 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 7 al 11 de octubre 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 7 al 11 de octubre 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 7 al 11 de octubre 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 7 al 11 de octubre de 2024					
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	400,1 107,0 50,0	300,0 200,0 200,0	265,0 70,0 25,0	300,0 300,0 30,0	100,0 100,0 Desierta 100,0 280,0
Propuestas recibidas	480,0 117,0 50,0	645,0 675,0 240,0	265,0 70,0 50,0	800,0 460,0 35,0	270,0 150,0 160,0 290,0
Plazo de vencimiento	99 d 182 d 273 d	98 d 182 d 273 d	98 d 182 d 273 d	97 d 182 d 273 d	97 d 182 d 364 d 91 d 182 d
Tasas de interés: Mínima	5,15 5,04 4,80	5,15 4,99 4,74	5,19 5,00 4,84	5,05 4,90 4,84	5,20 4,95 - 5,10 4,90
Máxima	5,28 5,04 4,80	5,17 5,01 4,84	5,34 5,05 4,84	5,10 5,00 4,84	5,20 4,95 - 5,18 4,95
Promedio	5,21 5,04 4,80	5,15 5,01 4,79	5,25 5,04 4,84	5,08 4,93 4,84	5,20 4,95 - 5,14 4,93
Saldo	51 489,6	51 489,6	51 049,7	50 860,7	50 740,7
Próximo vencimiento de SC-Venta el 7 de Octubre del 2024	700,0	799,9	819,0	700,0	780,0
Vencimiento de SC - Venta del 7 al 11 de octubre de 2024	3 018,9	2 318,9	1 519,0	700,0	3 477,9
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 7 al 11 de octubre 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 7 al 11 de octubre 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$)	0,0	1,8	0,2	1,0	0,2
i. Compras (millones de US$)	0,0	1,8	0,2	1,0	0,2
ii. Ventas (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	85,5	0,0	78,9	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	85,5	0,0	78,9		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 751,6**	**12 604,3**	**11 210,8**	**11 376,3**	**8 505,1**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0162%	0,0162%	0,0162%	0,0162%	0,0162%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	817,5	0,0	0,0	286,5	181,3
Tasa de interés	3,25%	3,25%	3,25%	3,25%	3,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 934,1**	**12 604,3**	**11 210,8**	**11 089,8**	**8 323,8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 880,1	12 712,7	19 517,9	18 588,9	18 412,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,6	5,6	8,5	8,1	8,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 703,2	5 535,8	12 604,3	11 675,3	11 498,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,5	2,4	5,5	5,1	5,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 631,3	1 365,0	1 323,0	1 399,0	1 452,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	5,25 / 5,25 / 5,25	5,25 / 5,25 / 5,25	5,25 / 5,25 / 5,25	5,25 / 5,25 / 5,25	5,25 / 5,25 / 5,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	15,0	165,0	110,0	15,0	15,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00	5,00 / 5,00 / 5,00
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.27 2024**	**Set.30 2024**	**Oct.01 2024**	**Oct.02 2024**	**Oct.03 2024**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	42,8	-47,3	-8,2	76,4	-119,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-51,1	-84,0	39,9	105,6	-293,6
a. Mercado spot con el público	-17,1	-119,2	59,7	160,1	-281,0
i. Compras	777,3	1199,8	739,7	763,9	617,5
ii. (-) Ventas	794,4	1319,0	680,0	603,8	898,5
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	243,4	222,1	41,3	-94,5	-296,6
i. Pactadas	267,5	541,1	247,6	162,5	204,3
ii. (-) Vencidas	24,2	319,0	206,4	257,1	500,9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	29,8	89,8	87,0	-177,6	-520,1
i. Pactadas	494,3	653,2	756,2	520,0	1035,6
ii. (-) Vencidas	464,5	563,4	669,2	697,6	1555,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	472,6	404,0	420,0	397,4	391,1
ii. A futuro	121,0	30,0	20,0	0,0	10,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	419,8	287,6	451,0	388,5	1047,3
i. Compras	440,8	557,6	655,9	630,3	1539,0
ii. (-) Ventas	21,0	270,0	204,9	241,8	491,6
f. Efecto de Opciones	1,4	0,5	-6,8	0,9	-2,6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-134,5	-104,1	-3,5	-115,5	-52,3
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)	3,7162	3,7058	3,7161	3,7196	3,7290
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera