# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

**(Millones de Soles)**

| | 07 Oct 24 | 09 Oct 24 | 10 Oct 24 | 11 Oct 24 |
|---|---|---|---|---|
| **1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP** | **7 041,8** | **7 436,7** | **7 917,8** | **9 984,0** |
| **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) | | 50,0 200,0 | 400,0 | 400,0 200,0 |
| Propuestas recibidas | | 170,0 825,5 | 956,5 | 1074,2 434,0 |
| Plazo de vencimiento | | 546 d 182 d | 181 d | 95 d 269 d |
| Tasas de interés: Mínima | | 4,33 4,52 | 4,37 | 4,85 4,50 |
| Máxima | | 4,34 4,73 | 4,67 | 4,93 4,60 |
| Promedio | | 4,33 4,69 | 4,65 | 4,89 4,58 |
| Saldo | 36 751,8 | 37 101,8 | 37 601,8 | 36 659,8 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Octubre del 2024 | 1 742,0 | 1 742,0 | 1 742,0 | 1 501,3 |
| Vencimiento de CD BCRP del 14 al 18 de octubre de 2024 | 1 742,0 | 1 742,0 | 1 742,0 | 2 950,4 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | 1000,0 2700,0 | 700,0 | 300,0 | 600,0 |
| Propuestas recibidas | 1000,0 2700,0 | 700,0 | 300,0 | 1350,0 |
| Plazo de vencimiento | 2 d 2 d | 1 d | 1 d | 91 d |
| Tasas de interés: Mínima | 5,25 5,25 | 5,25 | 5,25 | 5,33 |
| Máxima | 5,28 5,28 | 5,25 | 5,25 | 5,36 |
| Promedio | 5,27 5,26 | 5,25 | 5,25 | 5,35 |
| Saldo | 13 910,5 | 10 910,5 | 10 260,5 | 10 260,5 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 14 de Octubre del 2024 | 3 700,0 | 1 200,0 | 600,0 | 200,0 |
| Vencimiento de Repo Valores del 14 al 18 de octubre de 2024 | 4 500,0 | 1 500,0 | 600,0 | 1 120,0 |
| 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 14 al 18 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 | 4 818,8 | 4 818,8 | 4 619,3 | 4 619,3 |
| Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 14 de Octubre del 2024 | 199,6 | 199,6 | 412,9 | 412,9 |
| Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 14 al 18 de octubre de 2024 | 199,6 | 199,6 | | 412,9 |
| 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 |
| 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 |
| 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 14 al 18 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 14 al 18 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 14 al 18 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 14 al 18 de octubre de 2024 | | | | |
| xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP) | 500,1 | | 500,0 | 1 000,0 1 000,0 2100,1 |
| Propuestas recibidas | 1 694,0 | | 1 581,5 | 3 469,0 2 026,5 3697,7 |
| Plazo de vencimiento | 7 d | | 7 d | 3 d 7 d 3 d |
| Tasas de interés: Mínima | 4,80 | | 4,75 | 4,65 4,78 4,80 |
| Máxima | 4,95 | | 4,75 | 5,01 5,00 4,80 |
| Promedio | 4,93 | | 4,75 | 4,94 4,89 4,80 |
| Saldo | 3 000,0 | 2 000,1 | 1 500,1 | 5 100,2 |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 14 de Octubre del 2024 | 999,9 | 1 000,0 | 500,0 | 3 600,2 |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo del 14 al 18 de octubre de 2024 | 2 499,9 | 1 500,0 | 500,0 | 5 100,2 |
| xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP) | | | | 300,0 |
| Propuestas recibidas | | | | 930,0 |
| Plazo de vencimiento | | | | 33 d |
| Tasas de interés: Mínima | | | | 5,33 |
| Máxima | | | | 5,33 |
| Promedio | | | | 5,33 |
| Saldo | 600,0 | 600,0 | 600,0 | 900,0 |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 31 de Octubre del 2024 | 300,0 | 300,0 | 300,0 | 300,0 |
| Vencimiento de Coloc-TP del 14 al 18 de octubre de 2024 | 0,0 | | | 0,0 |
| 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 14 al 18 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 14 al 18 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 14 al 18 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 14 al 18 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 14 al 18 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 14 al 18 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 14 al 18 de octubre de 2024 | | | | |
| xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | 220,0 Desierta Desierta 350,0 | 494,0 220,0 Desierta 300,0 300,0 | 303,0 10,0 Desierta 200,0 65,0 | 400,0 Desierta |
| Propuestas recibidas | 330,0 -.- -.- 375,0 | 584,0 298,7 913,0 718,0 | 333,0 73,0 280,0 65,0 | 628,0 -.- |
| Plazo de vencimiento | 94 d 182 d 365 d 98 d | 97 d 182 d 273 d 98 d 89 d | 103 d 182 d 365 d 91 d 182 d | 103 d 182 d |
| Tasas de interés: Mínima | 5,19 - - 5,04 | 5,14 4,88 - 4,85 4,90 | 5,14 4,89 - 5,14 4,85 | 5,14 - |
| Máxima | 5,20 - - 5,20 | 5,20 4,95 - 4,99 4,98 | 5,20 4,89 - 5,20 4,95 | 5,20 - |
| Promedio | 5,20 - - 5,14 | 5,18 4,91 - 4,94 4,94 | 5,17 4,89 - 5,19 4,91 | 5,18 - |
| Saldo | 50 530,7 | 50 884,7 | 50 462,8 | 50 124,8 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 15 de Octubre del 2024 | 960,0 | 999,9 | 738,0 | 992,0 |
| Vencimiento de SC - Venta del 14 al 18 de octubre de 2024 | 2 697,9 | 1 737,9 | 738,0 | 3 549,5 |
| 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 14 al 18 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 14 al 18 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 |
| i. Compras (millones de US$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tipo de cambio promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| ii. Ventas (millones de US$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tipo de cambio promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$) | 0,0 | 5,4 | 2,0 | 0,1 |
| i. Compras (millones de US$) | 0,0 | 5,4 | 2,0 | 0,1 |
| ii. Ventas (millones de US$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP | 77,9 | 83,7 | 0,0 | 0,0 |
| i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR | | | | |
| ii. Compras de BTP (Valorizado) | 77,9 | 83,7 | | |
| **3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones** | **10 696,8** | **8 008,7** | **7 612,8** | **6 771,0** |
| **4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones** | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0162% | 0,0162% | 0,0162% | 0,0162% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tasa de interés | | | | |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | |
| Tasa de interés | | | | |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 90,0 | 1 242,0 | 820,3 | 576,0 |
| Tasa de interés | 3,25% | 3,25% | 3,25% | 3,25% |
| **5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones** | **10 606,8** | **6 766,7** | **6 792,5** | **6 195,0** |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*) | 16 656,5 | 17 049,8 | 16 382,1 | 16 163,1 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 7,3 | 7,5 | 8,0 | 7,1 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 9 742,9 | 10 136,3 | 9 462,4 | 9 222,0 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 4,3 | 4,4 | 4,6 | 4,0 |
| **6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP** | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 1 341,0 | 1 381,0 | 1 425,0 | 1 628,5 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO | 5,25 / 5,25 / 5,25 | 5,25 / 5,25 / 5,25 | 5,25 / 5,25 / 5,25 | 5,25 / 5,25 / 5,25 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$) | 70,0 | 70,0 | 70,0 | 70,0 |
| 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 |
| 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$)** | **Oct.04 2024** | **Oct.07 2024** | **Oct.09 2024** | **Oct.10 2024** |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g | 151,9 | -49,5 | 66,5 | -37,2 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g | 122,5 | -31,7 | 308,4 | 182,6 |
| a. Mercado spot con el público | 137,5 | -35,4 | 302,6 | 188,3 |
| i. Compras | 553,3 | 512,4 | 1083,3 | 527,7 |
| ii. (-) Ventas | 415,7 | 547,8 | 780,6 | 339,4 |
| b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega) | 68,1 | 8,3 | -72,0 | -57,6 |
| i. Pactadas | 203,5 | 152,3 | 146,4 | 277,4 |
| ii. (-) Vencidas | 135,4 | 144,0 | 218,5 | 335,0 |
| c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega) | 4,8 | -27,9 | 258,1 | 48,8 |
| i. Pactadas | 628,9 | 642,9 | 838,2 | 795,5 |
| ii. (-) Vencidas | 624,1 | 670,8 | 580,0 | 746,6 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | |
| i. Al contado | 410,7 | 290,8 | 397,9 | 384,3 |
| ii. A futuro | 70,0 | 35,0 | 110,0 | 195,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 479,2 | 521,6 | 359,9 | 405,8 |
| i. Compras | 607,9 | 661,2 | 572,4 | 722,1 |
| ii. (-) Ventas | 128,7 | 139,5 | 212,6 | 316,3 |
| f. Efecto de Opciones | -6,1 | -0,5 | -4,8 | -4,4 |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -33,3 | -44,6 | 100,6 | -108,9 |
| 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) | 3,7320 | 3,7402 | 3,7561 | 3,7668 |
| (*) Datos preliminares | | | | |

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera