BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	10 Dic 24	11 Dic 24	12 Dic 24	13 Dic 24
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 273,6**	**9 035,5**	**9 384,0**	**7 951,7**
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)				
Propuestas recibidas	30.0	30.0		
Plazo de vencimiento	80.0	90.0		
Tasas de interés: Mínima	357 d	539 d		
Máxima	4.31	4.24		
Promedio	4.31	4.24		
Saldo	4.31	4.24		
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de Diciembre del 2024	37 121.0	37 166.0	37 166.0	37 166.0
Vencimiento de CD BCRP del 16 al 20 de diciembre de 2024	1 667.0	1 667.0	1 667.0	1 667.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)		0.0		4 225.4
Propuestas recibidas	1100.0			400.0
Plazo de vencimiento	3600.0			1400.0
Tasas de interés: Mínima	1 d			91 d
Máxima	5.28			5.24
Promedio	5.29			5.25
Saldo	5.29			5.24
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 20 de Diciembre del 2024	9 285.5	8 185.5	8 185.5	8 285.5
Vencimiento de Reso Valores del 16 al 20 de diciembre de 2024	1 100.0	500.0	500.0	400.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)	1 600.0	500.0	500.0	400.0
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Reco de Cartera General				
Vencimiento de Reco de Cartera General del 16 al 20 de diciembre de 2024				
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	2 607.3	2 607.3	2 607.3	2 607.3
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 16 de Diciembre del 2024	16.7	16.7	16.7	16.7
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativo del 16 al 20 de diciembre de 2024		0.0		16.7
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 Reco Especial - CDR del 16 al 20 de diciembre 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 Reco de Cartera para el Apoyo de Liquidez				
Vencimientos de Reco de Cartera para el Apoyo de Liquidez del 16 al 20 de diciembre 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 diciembre 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 diciembre de 2024				
xi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)			1 400.1	1 000.0
Propuestas recibidas			1 843.9	2 607.6
Plazo de vencimiento			1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima			4.50	4.65
Máxima			5.00	4.95
Promedio			4.87	4.87
Saldo			1 400.1	1 000.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 16 de Diciembre del 2024			1 400.1	1 000.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 16 al 20 de diciembre de 2024			1 400.1	1 000.0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0			200.0 300.0
Propuestas recibidas	902.7			379.6 534.6
Plazo de vencimiento	31 d			91 d 35 d
Tasas de interés: Mínima	5.13			5.10 5.16
Máxima	5.30			5.15 5.25
Promedio	5.17			5.12 5.19
Saldo	2 100.0	2 100.0	2 100.0	2 100.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de Diciembre del 2024	900.0	900.0	900.0	900.0
Vencimiento de Coloc-TP del 16 al 20 de diciembre de 2024	900.0	900.0	900.0	900.0
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 16 al 20 de diciembre 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 diciembre 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 diciembre 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 Reco Regular				
Vencimiento de REPO del 16 al 20 de diciembre 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 Reco				
Vencimiento de REPO del 16 al 20 de diciembre 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 Reco Expansion				
Vencimiento de REPO Expansión del 16 al 20 de diciembre 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 Reco Sustitucion				
Vencimiento de REPO Sustitución del 16 al 20 de diciembre de 2024				
xx. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0 200.0 Desierta	200.0 Desierta 200.0	400.0 300.0 200.0	400.0
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento	90 d 182 d 274 d	90 d 365 d 86 d	90 d 182 d 89 d	91 d
Tasas de interés: Mínima	4.51 4.44 -	4.50 - 4.49	4.38 4.33 4.35	4.41
Máxima	4.95 4.85 -	4.50 - 4.50	4.85 4.90 4.85	4.90
Promedio	4.95 4.85 -	4.50 - 4.50	4.85 4.88 4.88	4.88
Saldo	47 990.8	47 990.8	47 996.8	47 996.7
Próximo vencimiento de SC-Venta del 16 de Diciembre del 2024	400.0	674.0	400.1	413.0
Vencimiento de SC - Venta del 16 al 20 de diciembre de 2024	1 474.1	1 074.1	400.1	2 677.9
xxi. Subasta de Reso 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 diciembre 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 Reso de Tasas de Interés del 16 al 20 de diciembre de 2024				
b. Liquid. Reos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)	0.0	0.0	0.0	0.0
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$)	0.5	16.0	0.0	14.0
i. Compras (millones de US$)	0.5	16.0	0.0	14.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	108.4	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR			0.0	
ii. Compras de BTP (Valorizado)		108.4		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**9 613.8**	**9 034.2**	**8 637.8**	**7 979.3**
4. Operaciones monetarias del BCR tras el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0.0 0.00%	0.0 0.00%	0.0 0.00%	0.0 0.00%
Promedio (tasa efectiva diaria)	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Compra temporal directa de valores (Repo de entrada)				
Tasa de interés				
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	388.0	326.1	195.7	25.5
Tasa de interés	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**9 226.8**	**8 708.1**	**8 442.1**	**7 953.8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	17 207.6	17 035.1	16 885.4	10 803.0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	7.5	7.4	7.3	4.7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	10 160.6	9 950.6	9 840.6	9 712.5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	4.4	4.3	4.3	4.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 373.5	1 797.6	1 452.0	1 787.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	5.00 / 5.00 / 5.00	5.00 / 5.00 / 5.00	5.00 / 5.00 / 5.00	5.00 / 5.00 / 5.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	10.0	40.0	66.5	40.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	4.75 / 4.75 / 4.75	4.75 / 4.75 / 4.75	4.75 / 4.75 / 4.75	4.75 / 4.75 / 4.75
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$)	**Dic. 06 2024**	**Dic. 10 2024**	**Dic. 11 2024**	**Dic.12 2024**
Flujo de la posición diaria = a + b.i - c.i + e + f + g	63.6	-9.5	26.0	66.0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-91.1	-62.4	291.2	117.1
a. Mercado spot con el público	-112.9	-57.4	276.1	139.1
i. Compras	896.2	1220.0	927.1	1178.9
ii. (-) Ventas	1009.0	1277.4	651.0	1039.8
b. Compras forward y swap al público (con v sin entrega)	198.8	228.6	215.6	260.4
i. Pactadas	219.3	226.2	241.2	438.5
ii. (-) Vencidas	80.5	294.7	356.7	528.9
c. Ventas forward y swap al público (con v sin entrega)	-6.2	-169.5	151.8	23.2
i. Pactadas	359.1	630.7	1382.5	1058.5
ii. (-) Vencidas	365.3	800.2	1230.7	1035.3
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	333.0	391.3	531.8	534.3
ii. A futuro	0.0	0.0	125.0	185.0
e. Operaciones swof asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	300.0	595.4	880.1	480.6
i. Compras	358.9	760.4	1229.0	996.7
ii. (-) Ventas	49.9	255.0	339.9	514.0
f. Efecto de Opciones	0.0	1.6	-0.7	0.3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	7.2	-54.5	2.9	63.9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7230	3.7114	3.7209	3.7355
(*) Datos preliminares				

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera