

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	24 Setiembre 18	25 Setiembre 18	26 Setiembre 18	27 Setiembre 18	28 Setiembre 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	292.2	567.4	1 291.6	958.2	170.9
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 BCRP)					
Proyectos recibidos	50.0		50.0	50.0	
Plazo de vencimiento	242.0		112.0	242.5	
Tasas de interés	150.0		524.4	341.4	
Máxima	2.57		2.85	2.70	
Promedio	2.69		2.91	2.85	
Saldo	25 961.1	25 861.1	25 911.1	25 961.1	25 961.1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de setiembre de 2018	1 000.0		1 000.0		1 000.0
Vencimiento de CD BCRP del 25 al 28 de setiembre de 2018	0.0		0.0		0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Proyectos recibidos	300.0	100.0	200.0	400.0	300.0
Plazo de vencimiento	1.0	1.0	1.0	3.0	3.0
Tasas de interés	2.79	2.76	2.76	2.80	2.95
Máxima	2.79	2.76	2.76	2.80	2.95
Promedio	2.79	2.76	2.76	2.80	2.95
Saldo	5 000.0	4 800.0	4 800.0	4 700.0	5 300.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de diciembre de 2018	300.0		200.0		600.0
Vencimiento de REPO BCRP del 22 al 28 de setiembre de 2018	300.0		200.0		600.0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLDB BCRP)					
Proyectos recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDLDB BCRP el 25 de setiembre de 2018	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de CDLDB BCRP del 25 al 28 de setiembre de 2018	0.0		0.0		0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Proyectos recibidos				200.0	
Plazo de vencimiento				1.0	
Tasas de interés				2.10	
Máxima				2.23	
Promedio				2.21	
Saldo	0.0	0.0	0.0	200.0	0.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de agosto de 2018	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 25 al 28 de setiembre de 2018	0.0		0.0		0.0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Proyectos recibidos	1116.6				
Plazo de vencimiento	59.6				
Tasas de interés	3.69				
Máxima	3.97				
Promedio	3.78				
Saldo	3 300.0	3 300.0	3 300.0	3 300.0	3 300.0
Próximo vencimiento de Cobo TP el 24 de octubre de 2018	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de Cobo TP del 25 al 28 de setiembre de 2018	0.0		0.0		0.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reestructurados del BCRP (CDR BCRP)					
Proyectos recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 28 de setiembre de 2018	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 25 al 28 de setiembre de 2018	0.0		0.0		0.0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resular)					
Proyectos recibidos	620.0	300.0	300.0		
Plazo de vencimiento	182.4	182.4			
Tasas de interés	3.26	3.25			
Máxima	3.41	3.41			
Promedio	3.35	3.31			
Saldo	4 908.0	4 908.0	4 908.0	4 908.0	4 908.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 24 de agosto de 2018	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de REPO del 25 al 28 de setiembre de 2018	300.0		300.0		300.0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exansión)					
Proyectos recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	150.0	150.0	150.0	150.0	150.0
Próximo vencimiento de Repo Exansión el 14 de setiembre de 2018	150.0		150.0		150.0
Vencimiento de REPO Exansión del 25 al 28 de setiembre de 2018	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Proyectos recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 800.0	1 800.0	1 800.0	1 800.0	1 800.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 24 de agosto de 2018	200.0		200.0		200.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 25 al 28 de setiembre de 2018	0.0		0.0		0.0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Proyectos recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 400.0	1 400.0	1 400.0	1 400.0	1 400.0
Próximo vencimiento de SC Venta el 10 octubre de 2018	800.0		800.0		800.0
Vencimiento de SC - Venta del 25 al 28 de setiembre de 2018	0.0		0.0		0.0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Proyectos recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de SC - Compra del 25 al 28 de setiembre de 2018	0.0		0.0		0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compra (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Venta (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público				25.6	
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP / CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 142.2	967.4	1 441.6	1 288.2	776.9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal del BCRP del pasivo (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0076%	0.0076%	0.0076%	0.0076%	0.0086%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%
c. Crédito por revaluación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	41.5	86.0	168.0	431.9	940.1
d. Depósitos Overmight en moneda nacional	1 509.0	1 509.0	1 509.0	1 509.0	1 509.0
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 300.7	1 300.7	1 273.6	1 273.6	645.8
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 553.3	7 483.5	7 427.6	7 359.2	3 597.3
g. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.3	5.3	5.2	5.2	2.8
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 529.5	2 466.4	2 405.4	2 350.8	2 303.0
i. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.8	1.7	1.7	1.7	1.6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la venta en moneda nacional	1 322.0	1 322.0	1 435.4	1 435.4	1 247.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,752,752.75	2,752,752.75	2,752,752.75	2,752,752.75	2,752,752.75
b. Operaciones a la venta en moneda extranjera (millones de US\$)	5.0	5.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,002,002.00	2,002,002.00			
c. Total mercado secundario de CDBCRP - CDBCRP-NR y CDV	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	21 Setiembre 18	24 Setiembre 18	25 Setiembre 18	26 Setiembre 18	27 Setiembre 18
Plazo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	-15.3	77.0	83.2	-64.4	86.4
Plazo de la posición corriente = a + b1 - c1 + e + f + g	-194.3	14.5	-102.5	-75.2	-41.3
a. Mercado spot con el público	-120.4	-6.8	-91.2	-71.0	-64.9
i. Compras	-246.8	-226.4	-250.7	-232.2	-264.3
ii. Ventas	361.0	232.2	346.8	303.2	419.0
b. Contratos forward al público (con y sin entrega)	60.2	202.8	-77.8	-111.8	-101.8
i. Pacificados	131.8	269.1	164.5	347.3	215.1
ii. (i) Ventas	71.8	65.4	65.1	451.1	113.7
iii. Ventas forward al público (con y sin entrega)	112.2	137.5	-144.7	-126.0	-143.8
c. Pacificados	186.8	166.3	151.2	268.9	226.8
d. Ventas	74.4	48.8	345.9	414.9	94.3
e. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	931.0	968.3	1127.1	1008.2	1008.2
ii. A plazo	106.0	106.0	54.0	29.0	29.0
f. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forward sin entrega	24.3	21.1	159.4	-40.2	1.6
g. Compras	53.0	46.9	426.9	404.6	404.6
h. Ventas	28.7	25.8	169.5	-40.8	8.7
i. Saldo de Operaciones	2.4	-1.8	-1.8	-0.6	-0.6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-5.3	2.6	-6.9	-11.2	0.6
h. Saldo de Operaciones netas con otras instituciones financieras					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Databank)	3.2919	3.2987	3.3061	3.3043	3.3021