

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	09 Octubre 18	10 Octubre 18	11 Octubre 18	12 Octubre 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarías antes de las operaciones del BCRP	5 025,1	5 027,5	5 467,6	4 797,4
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones				
a. Operaciones monetarias anuladas del BCR				
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)				
Propuestas recibidas	300,0	50,0	100,0	500,0
Plazo de vencimiento	1148,0	200,0	384,0	1840,0
Tasas de interés: Mínima	175,4	540,6	357,4	174,4
Máxima	2,57	2,89	2,75	2,59
Promedio	2,64	2,91	2,78	2,85
Saldo	2,62	2,90	2,78	2,82
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de setiembre de 2018	24 611,1	25 261,1	25 079,6	25 079,6
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 12 de octubre de 2018		1 241,0		295,0
ii. Subasta de Comora Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de diciembre de 2018	4 700,0	4 700,0	4 700,0	4 700,0
Vencimiento de REPO BCRP del 11 al 12 de octubre de 2018		300,0		300,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 11 al 12 de octubre de 2018				
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas	1000,0	500,0	600,0	1000,0
Plazo de vencimiento	1981,5	1943,0	1498,3	2066,0
Tasas de interés: Mínima	1,4	1,4	1,4	1,4
Máxima	2,10	2,10	2,10	2,10
Promedio	2,47	2,37	2,17	2,39
Saldo	2,32	2,29	2,11	2,23
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de agosto de 2018	1 000,0	1 100,0	1 800,0	1 650,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 11 al 12 de octubre de 2018		1 100,0		1 650,0
v. Subasta de Colocación BCP en M.N. del Tesoro Público				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	3 300,0	3 300,0	3 300,0	3 300,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 24 de octubre de 2018		500,0		500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 11 al 12 de octubre de 2018		0,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reestructurados del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 11 al 12 de octubre de 2018				
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	4 908,0	4 908,0	4 908,0	4 908,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 24 de agosto de 2018		500,0		500,0
Vencimiento de REPO del 11 al 12 de octubre de 2018		0,0		0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exposición)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	150,0	150,0	150,0	150,0
Próximo vencimiento de Repo Exposición el 14 de setiembre de 2018		150,0		150,0
Vencimiento de REPO Exposición del 11 al 12 de octubre de 2018		0,0		0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	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
Vencimiento de REPO Sustitución del 11 al 12 de octubre de 2018		0,0		0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	2 200,0	2 200,0	2 200,0	2 200,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de octubre de 2018		800,0		800,0
Vencimiento de SC - Venta del 11 al 12 de octubre de 2018		0,0		800,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra el 11 al 12 de octubre de 2018		0,0		0,0
Vencimiento de SC - Compra del 11 al 12 de octubre de 2018		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	4,00			
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público				
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 bancarías en el BCR antes del cierre de operaciones	3 725,1	3 727,5	2 883,1	3 147,4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0076%	0,0076%	0,0076%	0,0096%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por regularización monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	105,0	56,6	0,0	35,0
Tasa de interés	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarías en el BCR al cierre de operaciones	3 371,9	3 289,9	2 883,1	3 112,4
i. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 773,2	3 773,2	3 043,1	3 268,8
ii. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,1	6,1	6,0	6,0
iii. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 781,1	2 785,0	2 045,5	2 584,7
iv. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,6	2,6	2,5	2,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 012,0	1 209,5	964,0	1 098,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75	2,50/2,75/2,70	2,75/2,90/2,81
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	78,0	49,0	34,0	40,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP / CDBCRP NR y CDV	0,0	0,0	40,5	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 bancarías (millones de US\$)	05 Octubre 18	09 Octubre 18	10 Octubre 18	11 Octubre 18
a. P&P de la posición global = a + b + c + e + f + g	14,9	43,6	-10,6	-129,3
b. P&P de la posición con el público = b + d - c + e + f + g	64,8	105,7	35,1	41,1
c. Mercado spot con el público	44,0	55,2	-15,0	-63,8
i. Compras	211,1	297,0	246,9	246,6
ii. Ventas	267,1	211,8	263,8	368,4
iii. Subastas de Swap al público (con y sin entrega)	5,7	4,2	-134,0	36,9
iv. Facturadas	275,0	183,8	31,2	153,3
v. Ventas	49,3	269,4	195,2	116,3
vi. Facturas forward al público (con y sin entrega)	416,9	62,7	79,1	41,1
vii. Facturas	416,9	239,2	129,1	41,1
viii. Ventas	367,6	176,5	208,2	305,6
c. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	569,2	514,7	706,2	750,0
ii. Futuros	30,0	10,0	10,0	24,0
iii. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	120,2	39,4	68,0	199,6
iv. Compras	252,7	147,0	189,9	259,6
v. Ventas	232,6	107,6	121,5	89,9
vi. Estructura de depósitos	4,6	5,9	0,7	0,0
vii. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-1,1	-0,4	35,1	-3,8
viii. Operaciones netas con otras instituciones financieras				
ix. Saldo por regularización monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datacel)	3,3219	3,3306	3,3139	3,3290
(*) Datos preliminares				