

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	31 Diciembre 18	2 Enero 19	3 Enero 19	4 Enero 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 073,0	3 197,4	4 252,1	4 692,0
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 BCRP)				
Propuestas recibidas	50,0	50,0	50,0	
Plazo de vencimiento	185,0	137,0	266,9	
Tasas de interés	2,75	3,10	2,88	
Máxima	2,80	3,12	2,92	
Promedio	2,79	3,11	2,90	
Saldo	27 060,9	27 110,9	26 565,9	26 565,9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 06 de diciembre de 2018		620,0		
Vencimiento de CD BCRP del 27 al 30 de noviembre de 2018		620,0		
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas	350,0	500,0	300,0	1150,0
Plazo de vencimiento	1050,0	1200,0	1030,0	3050,0
Tasas de interés	2,4	1,4	7,4	1,4
Máxima	5,75	3,33	3,25	2,86
Promedio	5,75	3,33	3,50	3,33
Saldo	5,75	3,33	3,36	3,03
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 27 de noviembre de 2018	5 660,0	7 550,0	5 400,0	5 100,0
Vencimiento de Repo BCRP del 27 al 30 de noviembre de 2018		2 150,0		500,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el				
Vencimiento de CDLD BCRP del 27 al 30 de noviembre de 2018				
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo al				
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 27 al 30 de noviembre de 2018				
v. Subasta de Colocación de Papeles del Tesoro Público				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Colocación de Papeles del Tesoro Público el				
Vencimiento de Colocación de Papeles del Tesoro Público del 27 al 30 de noviembre de 2018				
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas	4 000,0	4 000,0	4 000,0	4 000,0
Plazo de vencimiento		300,0		300,0
Máxima		0,0		0,0
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el				
Vencimiento de CDR BCRP del 27 al 30 de noviembre de 2018				
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resuari)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Máxima				
Promedio				
Saldo	5 408,0	5 708,0	5 708,0	5 708,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 06 de diciembre de 2018				
Vencimiento de Repo Regular del 27 al 30 de noviembre de 2018				
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exansión)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Máxima				
Promedio				
Saldo	150,0	150,0	150,0	150,0
Próximo vencimiento de Repo Exansión el 17 de febrero de 2019				
Vencimiento de Repo Exansión del 27 al 30 de noviembre de 2018				
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Máxima				
Promedio				
Saldo	1 800,0	1 800,0	1 800,0	1 800,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 8 de febrero de 2019				
Vencimiento de Repo Sustitución del 27 al 30 de noviembre de 2018				
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Máxima				
Promedio				
Saldo	1 690,0	1 690,0	1 690,0	1 690,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 04 de diciembre de 2018				
Vencimiento de SC - Venta del 27 al 30 de noviembre de 2018				
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra				
Vencimiento de SC - Compra del 27 al 30 de noviembre de 2018				
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio				
Ventas (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	3,10	0,00	0,00	0,00
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	3,1			
Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público				
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR v BTP				
i. Compras de CD BCRP v CD BCRP-NR				
Contratos de BTP				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 373,0	5 397,4	4 292,1	4 692,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (Isvosa)				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0097%	0,0104%	0,0104%	0,0095%
b. Compra temporal directa de valores (Rueta de subasta)				
Tasa de interés	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por reposición monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	217,0	5,0	20,0	145,0
Deudores Overmight en moneda nacional	1,20%	1,20%	1,20%	1,20%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 156,0	5 392,4	4 182,1	4 547,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 253,5	7 535,9	6 726,6	6 917,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,1	5,1	5,8	5,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 446,9	2 406,6	3 076,8	3 726,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,6	2,4	2,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 753,2	842,9	842,9	1 559,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2 752,75/2,75	2 752,75/2,75	2 752,75/2,75	2 752,80/2,76
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR v CDV	0,0	0,0	0,0	2 502,50/2,50
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				30,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 Diciembre 18	31 Diciembre 18	03 Enero 19	03 Enero 19
a. Flujos de posición (debil = + / + / - / - / + / + / - / - / + / +)				
Flujo de posición con (+) / (-) = + / - / + / - / + / - / + / - / + / -	41,3	67,5	41,3	56,3
Flujo de posición con (+) / (-) = + / - / + / - / + / - / + / -	-32,4	44,5	-15,0	52,4
Operaciones spot con el público	6,7	48,1	54,9	60,1
i. Compras	478,8	169,0	169,0	395,9
i (-) Ventas	478,1	117,5	275,2	335,8
ii. Compras forward al público (con y sin entrega)	52,4	165,4	85,4	126,9
i. Placadas	141,5	24,1	174,7	121,9
i (-) Ventas	89,1	42,3	89,3	20,7
ii. Ventas forward al público (con y sin entrega)	7,9	42,1	34,6	124,3
i. Placadas	86,9	43,6	23,6	412,7
i (-) Ventas	81,1	85,1	200,1	537,0
Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	573,0	128,7	308,7	682,6
i. Al plazo	30,0	3,0	10,0	3,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-23,8	49,9	48,7	305,7
i. Compras	97,5	115,0	115,0	533,9
i (-) Ventas	61,3	32,4	66,9	227,3
f. Efectos de Comercio	0,0	0,0	0,0	-14,8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-107,4	-11,2	-6,2	-4,1
h. Crédito por reposición monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3686	3,3755	3,3703	3,3692

(*) Datos preliminares