

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	10 Junio 19	11 Junio 19	12 Junio 19	13 Junio 19	14 Junio 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 752,1	4 240,1	4 313,0	4 825,8	4 230,0
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	252,0	50,0	100,0	50,0
Plazo de vencimiento	202,1	252,0	218,0	188,0	102,1
Tasas de interés	175,4	359,4	338,4	358,4	327,4
Máxima	2,48	2,58	2,64	2,60	2,49
Promedio	2,21	2,65	2,64	2,65	2,70
Saldo	250	2,62	2,64	2,65	2,57
Próximo vencimiento de CD BCRP el 2 de Julio de 2019	26 896,1	27 151,1	27 401,1	28 056,1	26 906,1
Vencimiento de CD BCRP del 10 al 14 de Junio de 2019	550,0	550,0	550,0	2 056,2	2 056,2
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	550,0	550,0	550,0	0,0	0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 750,0	5 750,0	5 750,0	5 750,0	5 750,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 17 de Junio de 2019	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 10 al 14 de Junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CCLD BCRP el 10 al 14 de Junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CCLD BCRP del 10 al 14 de Junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	300,0	300,0	1 179,5	633,8	1 950,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 14 de Junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 10 al 14 de Junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 400,0	4 400,0	4 400,0	4 400,0	4 400,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de Junio de 2019	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 10 al 14 de Junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 10 al 14 de Junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Reconstrucción de moneda extranjera (Reconar)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 431,1	11 431,1	11 431,1	11 431,1	11 281,1
Próximo vencimiento de Repo Reconar el 24 de Junio de 2019	150,0	150,0	150,0	150,0	131,0
Vencimiento de REPO Reconar del 10 al 14 de Junio de 2019	150,0	150,0	150,0	150,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Reconstrucción de moneda extranjera (Exaración)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Exaración	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Exaración del 10 al 14 de Junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Reconstrucción de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 10 al 14 de Junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Próximo vencimiento de SC Venta el 22 de Julio de 2019	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de SC - Venta del 10 al 14 de Junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
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	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 10 al 14 de Junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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 bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 752,1	3 688,1	2 933,5	4 142,0	2 280,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (reserva)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0105%	0,0105%	0,0105%	0,0105%	0,0095%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por revaluación monetaria en moneda nacional	1,00	1 280,0	654,0	1 400,0	80,0
Tasas de interés	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 742,1	2 408,1	2 279,5	2 745,0	2 200,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/))	9 076,8	9 022,9	8 923,3	8 705,6	8 701,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,9	5,9	5,6	5,7	5,7
c. Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/))	3 701,1	3 642,5	3 423,5	3 230,2	3 21,2
d. Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,4	2,4	2,2	2,2	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 010,2	1 048,8	1 100,8	1 002,2	1 002,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2 752,75/2,75	2 752,75/2,75	2 752,75/2,75	2 752,75/2,75	2 752,75/2,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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\$)	07 Junio 19	10 Junio 19	11 Junio 19	12 Junio 19	13 Junio 19
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	25,8	101,9	-19,4	102,7	-45,2
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	-28,6	101,9	-19,4	102,7	-45,2
a. Mercado spot con el público	-71,7	148,7	-71,7	104,2	3,0
Compras	284,2	378,3	312,4	416,8	363,9
ii. (1) Ventas	355,9	229,7	312,4	360,8	360,8
Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-46,9	25,2	176,2	16,3	-36,2
iii. (1) Ventas	169,9	89,5	382,2	159,1	-8,1
iv. (1) Ventas	123,0	63,3	206,3	142,3	186,9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-25,7	88,1	133,4	18,2	148,3
Pactadas	74,4	191,1	246,2	246,2	694,9
ii. (1) Ventas	101,1	105,0	349,3	227,9	662,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias	395,6	321,4	544,3	745,5	407,3
i. Al contado	78,0	80,0	191,9	37,0	30,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-6,7	88,7	154,4	84,6	456,6
Compras	65,0	104,2	246,1	194,0	636,9
ii. (1) Ventas	71,7	45,0	185,8	178,4	178,4
f. Efectos de Depósitos	10,0	0,0	0,0	0,0	0,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0,2	-3,8	-0,8	1,0	1,7
h. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3328	3,3337	3,3298	3,3398	3,3313
(*) Datos preliminares					