

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	29 Octubre 18	30 Octubre 18	31 Octubre 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 618,2	1 813,9	247,1
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	200,0	50,0
Plazo de vencimiento	237,0	817,0	210,0
Tasas de Inter Mínima	164 d	98 d	552 d
Máxima	2,50	2,50	3,05
Promedio	2,65	2,52	3,05
Saldo	2,64	2,51	2 102,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de setiembre de 2018	26 869,6	26 869,6	26 919,6
Vencimiento de CD BCRP del 31 de octubre de 2018			0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			
Propuestas recibidas			500,0
Plazo de vencimiento			300,0
Tasas de Inter Mínima			7 d
Máxima			3,01
Promedio			2,96
Saldo	5 200,0	5 200,0	3,11
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de diciembre de 2018			3,06
Vencimiento de REPO BCRP del 31 de octubre de 2018			6 000,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)			
Propuestas recibidas			800,0
Plazo de vencimiento			0,0
Tasas de Inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el			
Vencimiento de CDLD BCRP del 31 de octubre de 2018			0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			
Propuestas recibidas	200,0	500,0	0,0
Plazo de vencimiento	804,7	979,3	0,0
Tasas de Inter Mínima	1 d	1 d	0,0
Máxima	2,0	1,95	0,0
Promedio	2,02	2,05	0,0
Saldo	2,0	2,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de agosto de 2018	200,0	500,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 31 de octubre de 2018			0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público			
Propuestas recibidas			500,0
Plazo de vencimiento			0,0
Tasas de Inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	2 800,0	2 800,0	3 300,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 24 de octubre de 2018			500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 31 de octubre de 2018			0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el			
Vencimiento de CDR BCRP del 31 de octubre de 2018			0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)			
Propuestas recibidas			1,60
Plazo de vencimiento			1,85
Tasas de Inter Mínima			1,73
Máxima			4 065,0
Promedio			300,0
Saldo	4 908,0	4 908,0	4 908,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 24 de agosto de 2018			500,0
Vencimiento de REPO del 31 de octubre de 2018			0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	150,0	150,0	150,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 14 de Setiembre de 2018			150,0
Vencimiento de REPO Expansión del 31 de octubre de 2018			0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	1 800,0	1 800,0	1 800,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 24 de agosto de 2018			200,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 31 de octubre de 2018			0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			
Propuestas recibidas	300,0	300,0	300,0
Plazo de vencimiento	942,0	713,0	690,0
Tasas de Inter Mínima	58 d	58 d	58 d
Máxima	1,50	1,36	1,60
Promedio	1,60	1,50	1,85
Saldo	1,55	1,50	1,44
Próximo vencimiento de SC-Venta el 15 octubre de 2018	3 185,0	3 785,0	4 065,0
Vencimiento de SC - Venta del 31 de octubre de 2018			300,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra			
Vencimiento de SC - Compra del 31 de octubre de 2018			0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR			
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)			
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 y 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	1 168,2	1 313,9	1 497,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0105%	0,0105%	0,0093%
Tasa de interés	3,30%	3,30%	3,30%
b. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés			
c. Depósitos Overnight en moneda nacional	432,5	755,1	886,6
Tasa de interés	1,50%	1,50%	1,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones			
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 414,2	7 414,2	7 356,5
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,2	5,2	5,1
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 427,8	2 427,8	2 371,4
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,7	1,7
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1 446,5	1 446,5	741,0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	2,75/2,80/2,76	2,75/2,80/2,76	2,75/2,75/2,75
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,0	5,0	81,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	2,252/2,25/2,25	2,252/2,25/2,25	2,252/2,25/2,25
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	0,0	0,0	0,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)			
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	26 Octubre 18	29 Octubre 18	30 Octubre 18
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	95,1	-80,5	257,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f + g	-6,8	-120,7	-120,7
a. Mercado spot con el público	-23,7	-96,8	-93,6
i. Compras	229,3	293,8	345,6
ii. (i) Ventas	252,0	390,6	439,1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	16,8	-140,0	-74,1
i. Pactadas	127,7	364,7	266,2
ii. (i) Vencidas	110,9	504,7	360,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	1,6	-42,9	-216,4
i. Pactadas	130,0	321,2	290,8
ii. (i) Vencidas	128,4	364,1	567,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	1184,2	1322,5	1688,1
ii. A futuro	20,0	0,0	14,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	44,9	-118,1	191,7
i. Compras	107,0	362,4	530,1
ii. (i) Ventas	62,1	490,5	338,9
f. Efecto de Opciones	-2,9	-1,8	-2,3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	79,1	92,7	166,5
h. Efecto por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3464	3,3519	3,3605
(*) Datos preliminares			