BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	26 Diciembre 18	27 Diciembre 18	28 Diciembre 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**601,8**	**1 055,7**	**810,9**
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)			
Propuestas recibidas	50,0	50,1	
Plazo de vencimiento	178,0	118,0	
Tasas de inter Mínima	526 d	341 d	
Máxima	3,08	2,89	
Promedio	3,12	2,90	
Saldo	3.10	2.89	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 06 de diciembre de 2018	26 935,8	27 010,9	27 010,9
Vencimiento de CD BCRP del 27 al 30 de noviembre de 2018	620.0		620.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	0,0		620,0
Propuestas recibidas	300,0	300,0	
Plazo de vencimiento	490,0	900,0	
Tasas de inter Mínima	1 d	1 d	
Máxima	2.76	3,32	
Promedio	3.80	3.32	
Saldo	2.90	3.32	
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 27 de noviembre de 2018	6 100,0	6 100,0	5 600,0
Vencimiento de REPO BCRP del 27 al 30 de noviembre de 2018	300,0		500,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)	500,0		800,0
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0,0		0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 27 al 30 de noviembre de 2018	0,0		0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	0,0		0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 27 al 30 de noviembre de 2018	0,0		0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público		300,0	500,0
Propuestas recibidas		818,3	859,9
Plazo de vencimiento		182 d	182 d
Tasas de inter Mínima		4,53	4,59
Máxima		5,34	5,10
Promedio		4,74	4,65
Saldo	3 200,0	3 500,0	4 000,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 26 de diciembre de 2018	300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 27 al 30 de noviembre de 2018	0,0		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	0,0		0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 27 al 30 de noviembre de 2018	0.0		0.0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	5 408,0	5 408,0	5 408,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 06 de diciembre de 2018	55,0		55,0
Vencimiento de REPO del 27 al 30 de noviembre de 2018	0,0		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 Expansion el 17 de Enero de 2019	150,0		150,0
Vencimiento de REPO Expansión del 27 al 30 de noviembre de 2018	0,0		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 Sustitucion el 8 de febrero de 2019	200,0		200,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 27 al 30 de noviembre de 2018	0,0		0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		300,0	
Propuestas recibidas		375,0	
Plazo de vencimiento		61 d	
Tasas de inter Mínima		2,10	
Máxima		2,25	
Promedio		2,23	
Saldo	2 290,0	1 990.0	1 690.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 04 diciembre de 2018	600,0		200,0
Vencimiento de SC - Venta del 27 al 30 de noviembre de 2018	900,0		0,0
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	0,0		0,0
Vencimiento de SC - Compra del 27 al 30 de noviembre de 2018	0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US$)			
Tiio de cambio promedio			
ii. Ventas (millones de US$)			
Tiio de cambio promedio			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US$)	245,70	15,47	172,50
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público	245,7	15,5	172,5
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público			
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP			
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR			
ii. Compras de BTP			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**851.8**	**1 605.6**	**1 310.9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0104%	0,0104%	0,0094%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés			
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	176,0	525,0	535,0
Tasa de interés	1.50%	1.50%	1.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**675,8**	**1 080,6**	**775,9**
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8 354,2	7 788,9	7 734,6
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,7	5,3	5,2
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 265,7	2 680,4	2 623,3
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,2	1,8	1,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 699,8	1 268,7	1 926,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75
b. Operaciones a la vista en moneda extraniera (millones de US$)	0,0	0,0	15,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio			2,50/2,50/2,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	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 Diciembre 18**	**26 Diciembre 18**	**27 Diciembre 18**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-104,4	2,0	-51,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-51,4	83,3	-178,4
a. Mercado spot con el público	-57,6	59,9	-129,8
i. Compras	450,9	424,5	511,2
ii (-) Ventas	508,5	364,6	641,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-105,7	-16,8	36,1
i. Pactadas	244,8	222,2	361,8
ii (-) Vencidas	350,5	239,1	325,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-232,4	-27,3	-178,9
i. Pactadas	221,4	256,2	299,1
ii (-) Vencidas	453,8	283,5	478,0
d.. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	530,1	667,1	560,3
ii. A futuro	5,0	160,0	70,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	99,2	45,5	102,6
i. Compras	435,1	281,4	427,0
ii (-) Ventas	335,9	235,9	324,4
f. Efecto de Opciones	-0,2	-2,3	1,7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-169,1	-67,1	-88,7
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3568	3,3678	3,3753
(*) Datos preliminares			

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera