BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	7 Enero 19	8 Enero 19	9 Enero 19	10 Enero 19	11 Enero 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**5 748,0**	**6 355,9**	**5 546,2**	**7 442,2**	**6 512,6**
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)	50.0 300.0	200.0 200.0	50.0 200.0 200.0	50.0 200.0 300.0	200.0 400.0
Propuestas recibidas	426.6 911.0	667.0 1196.0	776.0 569.0 768.0	301.0 750.0 1196.5	404.0 639.0
Plazo de vencimiento	176 d 94 d	93 d 175 d	540 d 359 d 174 d	358 d 358 d 173 d	357 d 172 d
Tasas de inte Mínima	2.78 2.58	2.60 2.77	3.05 2.89 2.78	2.89 2.88 2.77	2.88 2.77
Máxima	2.79 2.65	2.68 2.79	3.07 2.92 2.79	2.89 2.90 2.79	2.90 2.79
Promedio	2.78 2.61	2.64 2.79	3.07 2.89 2.78	2.89 2.89 2.78	2.88 2.77
Saldo	26 993.9	26 900.9	27 357.9	26 032.2	26 659.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de febrero de 2019	515.0		2 050.7		1 822.5
Vencimiento de CD BCRP del 14 al 18 de enero de 2019	2 565.7		2 050.7		0.0
ii. Subasta de Comora Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 100.0	5 100.0	4 600.0	4 600.0	4 600.0
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 24 de enero de 2019	500.0		250.0		250.0
Vencimiento de BRP) BCRP del 14 al 18 de enero de 2019	500.0		0.0		0.0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de CDLD BCRP del 14 al 18 de enero de 2019	0.0		0.0		0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	900.0	986.0 868.5	700.0 600.0	1500.0 500.0 1370.7	1000.0 500.0 1200.0
Propuestas recibidas	1166.6	986.0 868.5	1800.0 1451.1	2365.0 826.0 1370.7	2591.5 1628.0 2295.9
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 7 d 1 d	3 d 7 d 3 d
Tasas de inte Mínima	2.08	2.35 2.20	2.49 2.30	2.49 2.65 2.14	2.53 2.59 2.40
Máxima	2.49	2.75 2.75	2.65 2.52	2.65 2.74 2.75	2.61 2.65 2.72
Promedio	2.24	2.53 2.52	2.58 2.48	2.59 2.71 2.61	2.58 2.62 2.55
Saldo	900.0	1 854.5	1 300.0	3 370.7	3 200.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 14 de enero de 2019.	900.0		1 300.0		2 200.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 14 al 18 de enero de 2019	900.0		1 300.0		3 200.0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 000.0	4 000.0	4 000.0	4 000.0	4 000.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 2 de mayo de 2019	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 14 al 18 de enero de 2019	0.0		0.0		0.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 14 al 18 de enero de 2019	0.0		0.0		0.0
vii. Comora con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 708.0	5 708.0	5 708.0	5 708.0	5 708.0
Próximo vencimiento de Reno Regular el 17 de enero de 2019	55.0		55.0		55.0
Vencimiento de REPO del 14 al 18 de enero de 2019	0.0		0.0		55.0
viii. Comora con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	150.0	150.0	150.0	150.0	150.0
Próximo vencimiento de Reno Expansion el 17 de Enero de 2019	150.0		150.0		150.0
Vencimiento de REPO Expansión del 14 al 18 de enero de 2019	0.0		0.0		150.0
ix. Comora con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 800.0	1 800.0	1 800.0	1 800.0	1 800.0
Próximo vencimiento de Reco Sustitucion el 8 de febrero de 2019	200.0		200.0		200.0
Vencimiento de BRP) Sustitución del 14 al 18 de enero de 2019	0.0		0.0		0.0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 490.0	890.0	890.0	890.0	490.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 4 febrero de 2019	600.0		400.0		190.0
Vencimiento de SC - Venta del 14 al 18 de enero de 2019	1 000.0		400.0		0.0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
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 14 al 18 de enero de 2019	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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$)	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 498,0**	**4 101,4**	**3 796,2**	**3 521,5**	**3 212,6**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Comora temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0105%	0.0105%	0.0106%	0.0105%	0.0095%
b. Comora temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	207.0	241.0	103.8	71.5	123.0
Tasa de interés	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**4 291,0**	**3 860,4**	**3 692,4**	**3 450,0**	**3 089,6**
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9 311,5	9 252,9	9 232,1	9 157,0	9 111,7
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,2	6,1	6,1	6,1	6,0
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 131,2	4 065,4	4 042,6	3 966,6	3 919,6
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,7	2,7	2,7	2,6	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 411,7	961,8	2 000,8	2 000,8	755,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2.75/2.80/2.76	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.76	2.75/2.75/2.76	2.75/2.75/2.76
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	18,0	39,0	10,0	10,0	86,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	2.50/2.50/2.50	2.50/2.50/2.50	2.50/2.50/2.50	2.50/2.50/2.50	2.50/2.50/2.50
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$)	**04 Enero 19**	**07 Enero 19**	**08 Enero 19**	**09 Enero 19**	**10 Enero 19**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-122.7	83.3	-29.2	-180.2	190.5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-46.8	34.1	117.0	-89.0	1.8
a. Mercado spot con el público	-31.0	23.8	124.0	-100.9	-36.7
i. Compras	387.0	280.7	451.7	282.0	341.4
ii (-) Ventas	418.0	257.0	327.7	382.9	378.1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	7.5	67.5	30.7	117.4	77.9
i. Pactadas	86.2	356.1	194.2	190.7	269.7
ii (-) Vencidas	93.7	288.6	163.5	73.3	191.9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	67.9	41.9	0.7	307.8	-195.6
i. Pactadas	150.7	316.1	210.4	361.6	428.1
ii (-) Vencidas	82.8	260.3	211.2	143.8	638.7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	748.1	1118.5	959.2	1230.4	940.2
ii. A futuro	26.0	5.0	76.0	5.0	10.0
e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	8.6	-15.4	48.2	98.4	496.6
i. Compras	82.6	254.7	209.7	141.4	636.3
ii (-) Ventas	74.0	270.1	161.5	43.0	139.7
f. Efecto de Opciones	-0.4	-0.2	0.2	-0.9	0.2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-35.3	-61.9	-185.5	-16.0	-11.2
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.3556	3.3501	3.3484	3.3332	3.3421

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera