

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	11 Marzo 19	12 Marzo 19	13 Marzo 19	14 Marzo 19	15 Marzo 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 897,7	4 025,0	4 103,0	5 082,1	4 441,7
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCRP					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	50,0	200,0	50,0	150,0	150,0
Pago de vencimiento	301,0	554,0	200,0	429,5	445,0
Tasas de interés	176,4	37,4	639,4	355,4	355,4
Tasas de interés Mínima	2,61	2,80	2,91	2,78	2,80
Máxima	2,83	2,83	2,81	2,80	2,81
Promedio	2,61	2,91	2,80	2,78	2,80
Saldo	28 976,9	29 176,9	28 574,0	28 658,8	28 658,8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de marzo de 2019			1 451,1		2 464,5
Vencimiento de CD BCRP del 25 al 29 de marzo de 2019			1 451,1		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Pago de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 850,0	4 850,0	4 850,0	4 850,0	4 850,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de marzo de 2019			200,0		200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 25 al 29 de marzo de 2019			0,0		0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Pago de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el					
Vencimiento de CDLD BCRP del 25 al 29 de marzo de 2019					
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas		200,0		715,5	725,0
Pago de vencimiento		563,0		563,0	725,0
Tasas de interés Mínima		1,4		1,4	3,4
Máxima		2,0		2,15	2,40
Promedio		2,42		2,75	2,75
Saldo	0,0	200,0		715,5	725,0
Próximo vencimiento de Depósito a Plazo el 18 de marzo de 2019					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 25 al 29 de marzo de 2019					
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Pago de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 700,0	4 700,0	4 700,0	4 700,0	4 700,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 2 de mayo de 2019					
Vencimiento de Coloc-TP del 25 al 29 de marzo de 2019					
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Rescatables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Pago de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el					
Vencimiento de CDR BCRP del 25 al 29 de marzo de 2019					
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reoutar)					
Propuestas recibidas					
Pago de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7 553,1	7 553,1	7 553,1	7 553,1	7 553,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de marzo de 2019					
Vencimiento de REPO del 25 al 29 de marzo de 2019					
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exarstion)					
Propuestas recibidas					
Pago de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Exarstion el					
Vencimiento de REPO Exarstion del 25 al 29 de marzo de 2019					
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Substitución)					
Propuestas recibidas					
Pago de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	900,0	900,0	900,0	900,0	900,0
Próximo vencimiento de Repo Substitución el 22 de marzo de 2019					
Vencimiento de REPO Substitución del 25 al 29 de marzo de 2019					
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Pago de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el					
Vencimiento de SC - Venta del 25 al 29 de marzo de 2019					
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Pago de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra					
Vencimiento de SC - Compra del 25 al 29 de marzo de 2019					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR					
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\$)					
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					
Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 847,7	3 825,0	3 438,5	4 158,0	3 641,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal directa de moneda extranjera (swes)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0076%	0,0076%	0,0076%	0,0076%	0,0086%
b. Compra temporal directa de valores (para de subasta)					
Tasa de interés	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por revaluación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	150,0	80,0	0,0	0,0	20,0
Depósitos Overnigh en moneda nacional	1 526,0	1 526,0	1 526,0	1 526,0	1 526,0
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 897,7	3 545,0	3 438,5	4 158,0	3 621,7
i. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	9 544,3	9 538,7	9 652,2	9 467,1	9 474,0
ii. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,3	6,2	6,2	6,2	6,2
iii. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 292,4	4 156,7	4 105,1	4 105,3	4 108,8
iv. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,8	2,7	2,7	2,7	2,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 292,2	974,9	805,6	708,2	994,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,752,752,75	2,752,752,75	2,752,752,75	2,752,752,75	2,752,752,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	15,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,0	0,0	2,502,502,50	0,0	0,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Pago 6 meses (monto / tasa promedio)					
Pago 12 meses (monto / tasa promedio)					
Pago 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	08 Marzo 19	11 Marzo 19	12 Marzo 19	13 Marzo 19	14 Marzo 19
Flujo de la posición global = a + b + c + e + f + g	22,8	66,7	-11,3	69,6	-141,0
Flujo de la posición comercial = a + b + c + e + f + g	201,5	36,4	21,2	49,8	112,7
a. Mercado spot con el exterior	129,6	43,0	35,3	27,7	146,8
Compras	357,3	242,3	247,3	266,6	421,0
Ventas	227,7	198,9	212,0	238,9	308,3
b. Mercado forward público (con y sin entrega)	-114,9	-113,3	-113,3	-113,3	-226,4
Pedidos	52,7	178,6	173,9	184,7	66,6
(i) Ventas	266,9	169,9	207,4	152,0	314,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	63,8	116,3	-69,7	86,4	24,1
Pedidos	266,3	333,7	212,3	463,7	337,0
(i) Ventas	222,5	217,4	217,0	556,1	313,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
Al contado	568,7	478,0	706,7	754,3	699,6
Aplazado	12,0	12,0	12,0	12,0	177,0
e. Operaciones spot asociadas a saldos y vencimientos de bonos sin entrega	86,4	47,9	-8,6	348,3	-1,1
Compras	215,3	215,3	215,3	499,7	311,1
Ventas	128,9	167,4	223,9	151,4	312,2
f. Saldo de Operación	0,6	0,6	1,8	1,8	-1,2
Operaciones netas con otras instituciones financieras	5,1	3,1	-0,6	-3,7	-35,0
Saldo de Operación					
Tasa de interés					
Note: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Databank)	3,3140	3,3098	3,3012	3,2903	3,2963
(*) Datos preliminares					