

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	22 Abril 19	23 Abril 19	24 Abril 19	25 Abril 19	26 Abril 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	853,4	135,7	-557,7	-446,9	-368,2
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	50,0	
Plazo de vencimiento	174,3		289,0	304,5	
Tasas de interés	174,4		527,4	556,4	
Máxima	2,51		2,80	2,87	
Promedio	2,53		2,81	2,70	
Saldo	27 467,3	27 467,3	27 567,4	27 562,4	27 642,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de mayo de 2019			1 899,9		1 899,9
Vencimiento de CD BCRP del 29 de abril al 03 de mayo de 2019			0,0		
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1500,0	1400,0	800,0	805,0	800,0
Plazo de vencimiento	2200,0	1645,0	2470,0	2450,0	2450,0
Tasas de interés	1,0	1,0	1,0	1,0	1,0
Máxima	3,10	2,76	3,26	3,32	3,37
Promedio	3,18	3,30	3,31	3,33	3,38
Saldo	6 850,0	6 750,0	7 350,0	7 155,0	6 550,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 29 de abril de 2019			1 800,0		1 000,0
Vencimiento de REPO BCRP del 29 de abril al 03 de mayo de 2019			1 800,0		1 000,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el					
Vencimiento de CDLD BCRP del 29 de abril al 03 de mayo de 2019					
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 29 de abril al 03 de mayo de 2019					
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 700,0	4 700,0	4 700,0	4 700,0	4 700,0
Próximo vencimiento de Colocación TP el 2 de mayo de 2019			300,0		300,0
Vencimiento de Colocación TP del 29 de abril al 03 de mayo de 2019			0,0		300,0
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 el					
Vencimiento de CDR BCRP del 29 de abril al 03 de mayo de 2019					
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Rescatar)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	9 753,1	9 753,1	9 853,1	9 853,1	10 153,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 03 de junio de 2019			400,0		4,0
Vencimiento de REPO del 29 de abril al 03 de mayo de 2019			0,0		0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exposición)					
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 Exposición el					
Vencimiento de REPO Exposición del 29 de abril al 03 de mayo de 2019					
ix. Compra con compromiso de Recompra 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 el					
Vencimiento de REPO Sustitución del 29 de abril al 03 de mayo de 2019					
x. Subasta de Swap Cambiario Venta 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 Venta el					
Vencimiento de SC - Venta del 29 de abril al 03 de mayo de 2019					
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					
Vencimiento de SC - Compra del 29 de abril al 03 de mayo de 2019					
12. 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\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	5,6	2,6	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público			5,6	2,6	
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	2 483,4	1 535,7	1 592,3	1 108,1	831,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (rescatar)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0086%	0,0076%	0,0076%	0,0106%	0,0086%
b. Compra temporal directa de valores (fuera 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	157,0	66,0	419,0	163,0	164,0
Promedio	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	2 246,4	1 489,7	1 495,1	945,1	687,8
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 763,5	8 644,1	8 568,4	8 492,7	8 377,5
g. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,8	5,7	5,7	5,6	5,5
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 417,5	3 207,5	3 221,4	3 118,5	3 034,9
i. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,3	2,2	2,1	2,0	1,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 665,5	1 525,7	1 149,7	1 379,9	1 379,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2 752 752,75	2 752 752,75	2 752 752,75	2 752 802,75	2 752 752,75
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\$)	17 Abril 19	23 Abril 19	23 Abril 19	24 Abril 19	25 Abril 19
Pago de la posición global: $a + b + c + d + e + f + g$	86,4	79,2	54,1	47,4	47,4
Pago de la posición contable: $a + b + c + d + e + f + g$	86,4	79,2	54,1	47,4	47,4
a. Mercado spot con el público	27,1	174,5	22,1	-19,8	-50,9
i. Compras	363,8	65,6	347,7	40,4	87,2
ii. Ventas	411,0	329,1	325,3	424,2	418,1
b. Contratos forward al público (con y sin entrega)	62,4	-113,0	88,3	64,9	42,0
i. Pactadas	122,3	142,0	46,1	27,4	284,4
ii. (1) Ventadas	214,6	257,0	121,9	162,6	297,7
(1) Ventadas	67,9	-16,5	20,5	86,6	-5,3
(2) Ventadas forward al público (con y sin entrega)	813,7	165,5	307,9	307,9	272,3
(1) Ventadas	239,7	182,1	260,9	300,4	278,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
Al cobrado	815,9	682,0	597,7	543,7	463,2
Al cobrado	79,0	37,0	34,0	114,0	100,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega					
Compras	61,4	-71,4	149,0	156,0	79,4
Ventas	189,7	189,7	299,7	289,4	277,4
f. Efecto de liquidación	127,2	144,5	110,6	129,9	158,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
Compras	0,0	-2,8	0,0	-1,1	1,7
Ventas	-61,2	0,0	-10,0	-1,1	1,7
h. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Databank)	3,2956	3,3048	3,3108	3,3233	3,3316
(*) Datas preimprimadas					