

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	08 Julio 19	09 Julio 19	10 Julio 19	11 Julio 19	12 Julio 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	4 590,9	4 539,5	3 847,4	4 546,2	3 478,9
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)	50,0	300,0	200,0	50,0	100,0
Propuestas recibidas	114,5	1085,0	437,0	174,5	590,0
Plazo de vencimiento	183,4	300,0	546,4	545,4	725,0
Tasas de interés	2,50	2,57	2,62	2,57	2,55
Máxima	2,57	2,80	2,63	2,57	2,69
Promedio	2,55	2,58	2,62	2,57	2,69
Saldo	26 033,9	26 433,9	26 533,9	25 519,4	25 694,4
Promedio vencimiento de CD BCRP el 2 de agosto de 2019	1 095,0	1 095,0	1 095,0	2 079,1	2 079,1
Vencimiento de CD BCRP al 12 de julio de 2019	1 095,0	1 095,0	1 095,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 700,0	6 700,0	6 200,0	5 700,0	5 700,0
Promedio vencimiento de Repo de Valores el 1 de agosto de 2019	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de REPO BCRP al 12 de julio de 2019	1 000,0	1 000,0	500,0	0,0	0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio vencimiento de CELD BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CELD BCRP al 12 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	200,0	699,9	500,0	1350,0	400,0
Propuestas recibidas	1146,0	1726,5	1145,5	1797,3	1189,0
Plazo de vencimiento	1,4	1,4	1,4	1,4	3,4
Tasas de interés	2,20	2,18	2,10	2,10	2,06
Máxima	2,38	2,28	2,28	2,46	2,08
Promedio	2,33	2,28	2,22	2,29	2,08
Saldo	200,0	699,9	500,0	1 350,0	400,0
Promedio vencimiento de Depósitos a Plazo al 15 de julio de 2019	200,0	699,9	500,0	1 350,0	400,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo al 12 de julio de 2019	200,0	699,9	500,0	1 350,0	400,0
iv. Subasta de Colocación DP en M.N. de Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 100,1	4 100,1	4 100,1	4 100,1	4 100,1
Promedio vencimiento de Coloc-TP el 24 de octubre de 2019	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP al 12 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. 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
Promedio vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP al 12 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reoutar)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 750,1	11 750,1	11 750,1	11 750,1	11 750,1
Promedio vencimiento de Repo Realizar el 26 de setiembre de 2019	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de REPO al 12 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exención)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio vencimiento de Repo Exención	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Exención al 12 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. 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
Promedio vencimiento de Repo Sustitución	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Sustitución al 12 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Promedio vencimiento de SC-Venta el 22 de julio de 2019	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de SC - Venta al 12 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. 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
Promedio vencimiento de SC-Compra	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra al 12 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)					
iii. Tipo de cambio promedio					
iv. Compras con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Compras (Millones de US\$) - Tesoro Público	45,7				
vi. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
vii. Compras de CD BCRP + CD BCRP-NR					
viii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	4 040,9	3 435,5	3 297,4	3 146,2	2 878,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0087%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por revaluación monetaria en moneda nacional	890,0	440,5	481,0	324,0	568,5
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	3 150,9	2 999,0	2 836,4	2 822,2	2 310,4
i. Fondos de enajene en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	3 533,9	3 637,4	3 465,5	3 533,1	3 237,9
ii. Fondos de enajene en moneda nacional promedio acumulado (% del TOISE) (*)	6,5	6,3	6,2	6,1	6,1
iii. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 520,0	4 217,5	4 173,5	4 034,4	3 922,2
iv. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOISE) (*)	3,0	2,8	2,7	2,6	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	861,0	1 167,5	1 218,1	1 205,6	1 516,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2 652,75/2,75	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75	2,65/2,80/2,75	2,70/2,75/2,75
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\$)	05 Julio 19	08 Julio 19	09 Julio 19	10 Julio 19	11 Julio 19
Flujo de la posición total = a + b1 - c1 + e + f + g	-91,5	-39,9	130,1	153,3	153,3
Flujo de la posición comercial = a + b2 - c2 + e + g	17,1	46,1	87,7	59,2	65,2
a. Mercado spot con el público					
Compras	192,5	35,0	64,9	-16,1	38,4
Ventas	289,3	309,2	285,9	306,8	452,2
Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	46,5	77,6	107,9	17,4	-15,8
i. () Ventas	161,2	75,4	224,9	122,7	235,6
ii. () Ventas	102,7	15,1	117,9	105,2	254,4
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	141,5	11,5	310,3	107,6	-107,6
Plazadas	321,0	286,7	483,9	390,8	591,1
i. () Ventadas	179,5	297,2	163,2	257,1	706,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
Al contado	551,0	221,0	419,7	525,1	607,3
Al plazo	0,0	0,0	12,0	80,0	120,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	101,2	152,9	37,7	166,8	478,2
Compras	176,9	274,0	197,9	241,9	89,8
i. () Ventas	74,9	121,1	99,8	76,9	215,5
ii. () Ventas	102,0	152,9	98,1	164,9	183,3
Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,3	-1,7	1,3	-4,7	1,8
h. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Databe)	3,2958	3,2979	3,2913	3,2859	3,2839
(*) Datos preliminares					