

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	26 Ago 19	27 Ago 19	28 Ago 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 027,7	2 305,8	1 415,3
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	1,0	50,0
Plazo de vencimiento	163,0	117,0	117,0
Tasas de Inter Mínima	190,0	552,0	2,32
Máxima	2,19	2,32	2,32
Promedio	2,25	2,35	2,35
Saldo	28 188,1	28 188,1	28 271,9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de setiembre de 2019	1 601,0	1 601,0	1 601,0
Vencimiento de CD BCRP del 2 al 6 de setiembre del 2019	0,0	1 601,0	350,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			
Propuestas recibidas			450,0
Plazo de vencimiento			5,4
Tasas de Inter Mínima			2,70
Máxima			2,70
Promedio			2,70
Saldo	4 500,0	4 500,0	4 850,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 2 de setiembre de 2019	500,0	350,0	350,0
Vencimiento de REPO BCRP del 2 al 6 de setiembre del 2019	0,0	1 350,0	1 350,0
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 2 al 6 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 2 al 6 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	549,0	1100,0	1100,0
Propuestas recibidas	549,0	1374,5	1374,5
Plazo de vencimiento	1,0	1,0	1,0
Tasas de Inter Mínima	1,90	1,90	1,90
Máxima	2,50	2,45	2,45
Promedio	2,05	2,24	2,24
Saldo	549,0	1 100,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 28 de agosto de 2019	549,0	549,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 2 al 6 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	4 100,1	4 100,1	4 100,1
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 24 de octubre de 2019	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 2 al 6 de setiembre del 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 Inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 2 al 6 de setiembre del 2019	0,0	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	11 750,1	11 750,1	11 750,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 26 de setiembre de 2019	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de REPO del 2 al 6 de setiembre del 2019	0,0	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	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Expansión del 2 al 6 de setiembre del 2019	0,0	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	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 2 al 6 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	2 400,1	2 400,1	2 400,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 4 de octubre de 2019	600,1	600,1	600,1
Vencimiento de SC - Venta del 2 al 6 de setiembre del 2019	0,0	0,0	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	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 2 al 6 de setiembre del 2019	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
Tipo de cambio promedio			
ii. Ventas (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)			
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,6		0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,6		0,0
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	1 428,7	1 205,8	1 715,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0074%	0,0074%	0,0086%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	3,05%	3,05%	3,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés	140,4	206,4	913,9
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	140,4	206,4	913,9
Tasa de interés	1,25%	1,25%	1,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 293,3	999,4	901,4
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	8 257,5	8 133,3	8 133,3
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,3	5,2	5,2
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 731,1	2 603,4	2 603,4
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,8	1,7	1,7
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 031,7	1 081,2	1 159,8
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,50/2,50/2,50	2,50/2,50/2,50	2,50/2,50/2,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	18,0	64,5	20,5
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP: CDBCRP-NR y CDV			
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)			
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	23 Agosto 19	26 Agosto 19	27 Agosto 19
Flujo de la posición spot = a + b.i - c.i + e + f + g	-88,1	-85,3	27,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-74,1	88,1	29,9
a. Mercado spot con el público	-116,1	46,8	-36,1
i. Compras	230,4	385,9	416,5
ii (i) Ventas	355,5	319,1	452,5
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-22,2	-280,6	-76,1
i. Pactadas	106,1	243,1	165,8
ii (i) Vencidas	128,3	523,7	241,9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	2,1	-105,9	-74,6
i. Pactadas	144,7	346,5	483,5
ii (i) Vencidas	142,6	452,4	558,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	659,3	809,4	752,6
ii. A futuro	25,0	104,0	26,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	56,4	-33,5	377,4
i. Compras	138,8	445,2	553,4
ii (i) Ventas	82,3	478,7	176,1
f. Efecto de Opciones	0,3	0,3	-0,9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0,1	3,5	4,8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,3756	3,3784	3,3877
(*) Datos preliminares			