

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	20 Agosto 18	21 Agosto 18	22 Agosto 18	23 Agosto 18	24 Agosto 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 088,0	1 324,8	997,2	1 366,3	110,3
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)					
Procesos recibidos	50,0	50,0	50,0	50,0	0,0
Plazo de vencimiento	131,0	143,0	143,0	257,0	0,0
Tasas de interés	168,4	531,4	344,4	344,4	3,52
Máxima	2,57	2,70	2,80	2,80	3,26
Promedio	2,58	2,75	2,75	2,84	3,33
Saldo	25 181,4	25 181,4	25 201,4	25 201,4	25 281,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de setiembre de 2018		1 335,2	1 335,2	1 335,2	1 335,2
Vencimiento de CD BCRP del 23 al 24 de agosto de 2018		0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Procesos recibidos	100,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Plazo de vencimiento	200,0	500,0	500,0	500,0	300,0
Tasas de interés	1,4	2,90	2,90	182,4	182,4
Máxima	2,86	2,86	2,86	3,52	3,26
Promedio	2,86	2,83	2,83	3,49	3,33
Saldo	3 900,0	3 900,0	3 400,0	3 400,0	4 100,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de diciembre de 2018		500,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 23 al 24 de agosto de 2018		0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Procesos recibidos	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el					
Vencimiento de CDLD BCRP del 23 al 24 de agosto de 2018		0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Procesos recibidos	641,1	341,1	200,1	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	400,0	141,0	200,1	0,0	0,0
Tasas de interés	1 205,1	341,1	200,1	0,0	0,0
Máxima	52,0	52,0	52,0	0,0	0,0
Promedio	3,97	3,97	3,97	0,0	0,0
Saldo	2 800,0	2 800,0	2 800,0	2 800,0	2 800,0
Próximo vencimiento de Cobro TP el 24 de octubre de 2018		500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Cobro TP del 23 al 24 de agosto de 2018		0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Certificados de Depósitos Rescaudables del BCRP (CDR BCRP)					
Procesos recibidos	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el					
Vencimiento de CDR BCRP del 23 al 24 de agosto de 2018		0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recombra de moneda extranjera (Reoutar)					
Procesos recibidos	4 608,0	4 608,0	4 608,0	4 608,0	4 608,0
Plazo de vencimiento	500,0	500,0	500,0	500,0	600,0
Tasas de interés	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	4 608,0	4 608,0	4 608,0	4 608,0	4 608,0
Próximo vencimiento de Repo Reoutar el 24 de agosto de 2018		500,0	500,0	500,0	600,0
Vencimiento de REPO del 23 al 24 de agosto de 2018		0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recombra de moneda extranjera (Excausión)					
Procesos recibidos	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0
Plazo de vencimiento	800,0	800,0	800,0	800,0	800,0
Tasas de interés	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0
Próximo vencimiento de Repo Excausión el 14 de setiembre de 2018		800,0	800,0	800,0	800,0
Vencimiento de REPO Excausión del 23 al 24 de agosto de 2018		0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recombra de moneda extranjera (Sustitución)					
Procesos recibidos	2 300,0	2 300,0	2 300,0	2 300,0	1 800,0
Plazo de vencimiento	500,0	500,0	500,0	500,0	200,0
Tasas de interés	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	2 300,0	2 300,0	2 300,0	2 300,0	1 800,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 24 de agosto de 2018		500,0	500,0	500,0	200,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 23 al 24 de agosto de 2018		0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Procesos recibidos	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC - Compra					
Vencimiento de SC - Compra del 23 al 24 de agosto de 2018		0,0	0,0	0,0	0,0
x. 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\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Compras con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 532,0	1 824,8	1 497,2	1 316,3	1 310,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0,0078%	0,0078%	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					
Tasas de interés	1,50%	53,7	52,7	214,4	339,9
Depósitos Overmight en moneda nacional	1 532,0	1 771,1	1 444,5	1 101,9	970,4
Tasas de interés	6 451,3	7 981,7	7 761,6	6 451,3	7 553,8
Fontos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6,1	5,7	5,5	6,1	5,4
Fontos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,072,4	3,010,4	2,780,0	2,660,4	2,560,0
Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,6	2,1	2,6	2,6	1,8
Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)					
5. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 053,0	987,1	932,6	866,5	1 337,3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,752,762,75	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\$)	4,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,002,002,00	2,002,002,00	2,002,002,00	2,002,002,00	2,002,002,00
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	0,0	0,0	0,0	40,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
6. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	17 Agosto 18	20 Agosto 18	21 Agosto 18	22 Agosto 18	23 Agosto 18
a. Flujos de posición global = a + b + c + e + f + g	2,1	17,7	17,7	14,0	26,3
Flujos de posición comercial = a + b + c + e + f + g	62,8	76,7	76,7	61,0	31,2
Flujos de posición de inversión = a + b + c + e + f + g	77,1	56,2	56,2	46,0	25,5
Compras	209,1	209,1	209,1	209,1	209,1
(i) Ventas	182,0	195,5	195,5	238,0	274,4
ii. Ventas	16,1	5,2	5,2	23,8	19,7
b. Ventas	91,5	83,1	83,1	81,6	197,8
(i) Ventas	75,3	67,9	67,9	65,3	300,5
ii. Ventas	88,3	62,7	62,7	14,4	-100,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	306,6	340,5	340,5	197,5	196,6
Plazados	207,3	77,8	148,5	183,1	366,9
(i) Ventas					
d. Operaciones cambiarias interbancarias	788,4	807,0	885,8	1041,8	1225,1
(i) Al contado	47,0	47,0	47,0	47,0	47,0
(ii) Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	195,6	29,5	28,2	112,8	24,6
Compras	169,0	56,2	56,2	169,0	269,9
(i) Ventas	56,0	36,7	36,7	40,3	33,6
ii. Forwards	1,9	-1,1	-1,1	-1,2	-1,1
(i) Ventas	1,9	-1,1	-1,1	-1,2	-1,1
Operaciones netas con otras instituciones financieras	1,9	-1,1	-1,1	-1,1	-1,1
Operaciones netas con otras instituciones financieras	1,9	-1,1	-1,1	-1,1	-1,1
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Databank)	3,3219	3,3139	3,2976	3,2846	3,2952
(*) Datos preliminares					