

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	27 Agosto 18	28 Agosto 18	29 Agosto 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 546,3	1 793,9	121,2
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		50,0
Plazo de vencimiento	197,5		175,0
Tasas de Inter Mínima	161 d		524 d
Tasas de Inter Máxima	2,55		2,70
Tasas de Inter Promedio	2,57		2,75
Saldo	2,57		2,71
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de setiembre de 2018	25 331,4	25 331,3	25 381,3
Vencimiento de CD BCRP del 28 al 29 de agosto de 2018	1 335,2	1 335,2	1 335,2
Vencimiento de CD BCRP del 28 al 29 de agosto de 2018	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			
Propuestas recibidas			300,0
Plazo de vencimiento			600,0
Tasas de Inter Mínima			92 d
Tasas de Inter Máxima			5 d
Tasas de Inter Promedio			3,16
Saldo			2,78
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de diciembre de 2018	4 100,0	4 100,0	4 900,0
Vencimiento de REPO BCRP del 28 al 29 de agosto de 2018	200,0	200,0	500,0
Vencimiento de REPO BCRP del 28 al 29 de agosto de 2018	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter Mínima			
Tasas de Inter Máxima			
Tasas de Inter Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 28 al 29 de agosto de 2018	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			
Propuestas recibidas			700,0
Plazo de vencimiento			821,6
Tasas de Inter Mínima			1 d
Tasas de Inter Máxima			2,24
Tasas de Inter Promedio			2,70
Saldo	0,0	0,0	2,45
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de agosto de 2018	0,0	700,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 28 al 29 de agosto de 2018	0,0	700,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 28 al 29 de agosto de 2018	0,0	700,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter Mínima			
Tasas de Inter Máxima			
Tasas de Inter Promedio			
Saldo	2 800,0	2 800,0	2 800,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 24 de octubre de 2018	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 28 al 29 de agosto de 2018	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			
Tasas de Inter Máxima			
Tasas de Inter Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 28 al 29 de agosto de 2018	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)			
Propuestas recibidas	500,0	500,0	300,0
Plazo de vencimiento	970,0	970,0	478,0
Tasas de Inter Mínima	182 d	182 d	184 d
Tasas de Inter Máxima	3,31	3,31	3,13
Tasas de Inter Promedio	3,56	3,46	3,46
Saldo	3,42	3,18	3,18
Próximo vencimiento de Repo Regular el 24 de agosto de 2018	4 608,0	4 608,0	4 908,0
Vencimiento de REPO del 28 al 29 de agosto de 2018	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de REPO del 28 al 29 de agosto de 2018	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			
Tasas de Inter Máxima			
Tasas de Inter Promedio			
Saldo	1 250,0	1 250,0	1 250,0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 14 de Setiembre de 2018	800,0	800,0	800,0
Vencimiento de REPO Expansion del 28 al 29 de agosto de 2018	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			
Tasas de Inter Máxima			
Tasas de Inter Promedio			
Saldo	1 800,0	1 800,0	1 800,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 24 de agosto de 2018	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 28 al 29 de agosto de 2018	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter Mínima			
Tasas de Inter Máxima			
Tasas de Inter Promedio			
Saldo	800,0	800,0	800,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 15 octubre de 2018	800,0	800,0	800,0
Vencimiento de SC - Venta del 28 al 29 de agosto de 2018	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter Mínima			
Tasas de Inter Máxima			
Tasas de Inter Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 28 al 29 de agosto de 2018	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 28 al 29 de agosto de 2018	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación 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	13,3		
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			
ii. Compras de BTP			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 496,3	1 093,9	1 171,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0076%	0,0076%	0,0088%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés			
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	399,8	315,0	175,0
Tasa de interés	1,50%	1,50%	1,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 096,5	778,9	996,2
a. Fondos de encate en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 461,6	7 292,9	7 240,7
b. Fondos de encate en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,3	5,2	5,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 532,2	2 356,9	2 301,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,8	1,7	1,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1 018,5	659,5	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,0	0,0	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	28,4	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\$)	24 Agosto 18	27 Agosto 18	28 Agosto 18
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	-63,7	-14,8	-54,9
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	-30,2	-210,2	-16,5
a. Mercado spot con el público	-64,6	-206,3	-45,4
i. Compras	281,2	254,4	359,6
ii (-) Ventas	345,9	460,7	404,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	74,2	-21,3	-105,7
i. Pactadas	190,4	374,0	140,7
ii (-) Vencidas	116,2	395,3	246,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	109,4	-218,7	-67,6
i. Pactadas	234,5	225,6	295,1
ii (-) Vencidas	125,2	444,2	362,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	949,0	752,3	715,9
ii. A futuro	15,0	5,0	45,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	45,6	38,3	149,2
i. Compras	100,0	413,7	352,6
ii (-) Ventas	54,4	375,4	203,5
f. Efecto de Opciones	-1,7	-1,9	-0,3
g. Operaciones de swaps con otras instituciones financieras	-2,2	6,7	-4,0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)			
(*) Datos preliminares	3,2918	3,2896	3,2938