

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	03 Setiembre 18	04 Setiembre 18	05 Setiembre 18	06 Setiembre 18	07 Setiembre 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 714.4	3 419.6	4 183.3	5 843.7	4 697.7
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCRP					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Proveedores recibidos	50.0		50.0	50.0	500.0
Plazo de vencimiento	278.0		190.0	254.0	1446.0
Tasas de interés Mínima	182.4		545.4	362.4	91.4
Máxima	2.49		2.71	2.59	2.45
Promedio	2.55		2.72	2.60	2.59
Saldo	25 411.3	24 096.1	24 146.1	23 519.2	24 019.2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de setiembre de 2018	1 385.2		1 030.0	2 850.0	2 850.0
Vencimiento de CD BCRP del 4 al 7 de setiembre de 2018	2 026.2		1 030.0	0.0	2 850.0
ii. Subasta de Comera Temporal de Valores (REPO)					
Proveedores recibidos	1000.0	1900.0			
Plazo de vencimiento	1300.0	3210.0			
Tasas de interés Mínima	1.4	1.4			
Máxima	2.80	2.76			
Promedio	2.92	2.85			
Saldo	2.87	2.77	4 700.0	4 700.0	4 700.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de diciembre de 2018	7 600.0	5 450.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de REPO BCRP del 4 al 7 de setiembre de 2018	2 900.0		0.0	0.0	0.0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Proveedores recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0		0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 4 de setiembre de 2018	0.0		0.0	0.0	0.0
Vencimiento de CDLD BCRP del 4 al 7 de setiembre de 2018	0.0		0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Proveedores recibidos	700.0			500.0	800.0
Plazo de vencimiento	821.6			1 844.5	1 822.3
Tasas de interés Mínima	1.4			1.4	1.4
Máxima	2.24			2.40	2.25
Promedio	2.70			2.56	2.51
Saldo	2.45			2.50	2.43
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de agosto de 2018	0.0	0.0	0.0	1 300.0	500.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 4 al 7 de setiembre de 2018	0.0		0.0	1 300.0	500.0
v. Subasta de Colocación de Bonos del Tesoro Público					
Proveedores recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 800.0	2 800.0	2 800.0	2 800.0	2 800.0
Próximo vencimiento de Cobo-TP el 24 de octubre de 2018	500.0		500.0	500.0	500.0
Vencimiento de Cobo-TP del 4 al 7 de setiembre de 2018	0.0		0.0	0.0	0.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Rescatables del BCRP (CDR BCRP)					
Proveedores recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 4 de setiembre de 2018	0.0		0.0	0.0	0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 4 al 7 de setiembre de 2018	0.0		0.0	0.0	0.0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reacuar)					
Proveedores recibidos	300.0				
Plazo de vencimiento	478.0				
Tasas de interés Mínima	181.4				
Máxima	3.13				
Promedio	3.46				
Saldo	3.18		5 208.0	5 208.0	4 608.0
Próximo vencimiento de Repo Reacuar el 24 de agosto de 2018	4 908.0		600.0	600.0	300.0
Vencimiento de REPO del 4 al 7 de setiembre de 2018	600.0		600.0	600.0	0.0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exaracion)					
Proveedores recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 250.0	1 250.0	1 250.0	1 250.0	1 250.0
Próximo vencimiento de Repo Exaracion el 14 de setiembre de 2018	800.0		800.0	800.0	800.0
Vencimiento de REPO Exaracion del 4 al 7 de setiembre de 2018	0.0		0.0	0.0	800.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitucion)					
Proveedores recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 800.0	1 800.0	1 800.0	1 800.0	1 800.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 24 de agosto de 2018	200.0		200.0	200.0	200.0
Vencimiento de REPO Sustitucion del 4 al 7 de setiembre de 2018	0.0		0.0	0.0	0.0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Proveedores recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	800.0	800.0	800.0	800.0	1 100.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 octubre de 2018	800.0		800.0	800.0	800.0
Vencimiento de SC - Venta del 4 al 7 de setiembre de 2018	0.0		0.0	0.0	0.0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Proveedores recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0.0		0.0	0.0	0.0
Vencimiento de SC - Compra del 4 al 7 de setiembre de 2018	0.0		0.0	0.0	0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neocación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US\$)					
Compras (millones de US\$)					
Ventas (millones de US\$)			29.7	0.4	
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
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 / 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	4 884.4	4 488.6	4 133.3	4 193.7	3 897.7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compras temporales de moneda extranjera (Isowas)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0076%	0.0076%	0.0076%	0.0076%	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 recompra monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5.0	47.3	363.2	80.0	299.0
Próximo vencimiento	1 520.0	1 520.0	1 520.0	1 520.0	1 520.0
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4 859.4	4 859.4	3 770.1	3 770.1	3 386.7
i. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 727.7	7 951.5	9 176.4	8 222.7	6 232.5
ii. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.1	5.5	5.7	5.8	5.9
iii. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 270.8	2 618.5	3 109.3	3 192.0	3 204.5
iv. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.6	2.0	2.2	2.2	2.3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CD BCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	899.5	850.0	479.0	476.8	1 096.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2 752 752.75	2 752 752.75	2 752 752.75	2 752 752.75	2 702 752.74
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	50.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0.0	0.0	2 002 002.00	2 002 002.00	2 002 002.00
c. Total mercado secundario de CD BCRP / CD BCRP-NR y CDV	0.0	67.2	0.0	30.0	20.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				30.0 / 2.59	20.0 / 2.60
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	29 Agosto 18	03 Setiembre 18	04 Setiembre 18	05 Setiembre 18	06 Setiembre 18
Plazo de la posición (abcde = a + b + c + e + f + g)	174.9	-24.7	-75.8	-73.3	-38.3
Plazo de la posición corriente = a + b + c + e + f + g	-64.0	-29.8	-75.8	-102	-41.8
Operaciones spot con el público	-56.4	-174.8	-128.9	-20.6	-97.5
i. (f) Ventas	39.4	179.8	220.8	28.9	282.1
ii. (g) Ventas	450.8	353.8	353.8	316.2	379.6
iii. Subasta de Swap al público (con y sin entrega)	19.5	-52.3	-22.4	-3.7	-126.1
iv. (e) Ventas	220.1	135.2	261.8	157.9	318.7
v. (d) Ventas	62.8	187.5	161.9	161.9	448.8
vi. (c) Ventas forward al público (con y sin entrega)	-47.2	-14.6	-117.6	87.9	-207.9
vii. (b) Ventas	191.6	24.6	441.1	277.1	362.9
viii. (a) Ventas	238.8	39.2	323.5	219.2	600.6
Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	602.2	261.2	615.3	892.2	1171.6
ii. Al plazo	40.0	140.0	40.0	40.0	40.0
Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	153.8	8.9	231.1	77.8	203.3
i. Compras	183.0	8.9	319.0	216.0	396.1
ii. (f) Ventas	38.5	0.0	88.2	138.3	392.8
iii. (g) Ventas	-5.9	-0.2	-9.2	-1.7	-15.6
Operaciones netas con otras instituciones financieras	-5.1	-12.1	4.9	-9.6	8.4
iv. (d) Ventas forward al público (con y sin entrega)					
v. (c) Ventas					
Operaciones netas con otras instituciones financieras					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3.2962	3.3048	3.3160	3.3177	3.3199
(*) Datos preliminares					