

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	17 Setiembre 18	18 Setiembre 18	19 Setiembre 18	20 Setiembre 18	21 Setiembre 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 824,8	4 095,1	2 762,5	2 484,0	291,2
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)	50,0 300,0 159,8 2,53 2,53 2,53	300,0 1056,0 91,4 2,50 2,53 2,52	444,5 1145,0 167,4 2,53 2,55 2,57	300,0 1390,0 30,4 2,54 2,60 2,58	50,0 221,0 348,4 2,68 2,68 2,68
Saldo	24 616,6	25 361,1	25 711,1	25 786,1	25 786,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de setiembre de 2018	1 000,0	0,0	1 000,0	0,0	1 000,0
Vencimiento de CD BCRP del 18 al 21 de setiembre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Comera Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento	4 700,0	4 700,0	4 700,0	4 700,0	4 700,0
Tasas de interés Mínima	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de diciembre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO BCRP del 18 al 21 de setiembre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento	4 700,0	4 700,0	4 700,0	4 700,0	4 700,0
Tasas de interés Mínima	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 18 al 21 de setiembre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas		500,0 2081,0	850,0 1234,7	600,0 1413,4	500,1 1165,6
Plazo de vencimiento		1,4 2,40	1,4 2,26	1,4 2,20	1,4 2,20
Tasas de interés Mínima		2,53 2,47	2,57 2,46	2,48 2,32	2,38 2,32
Máxima		1 800,0 1 500,0	1 650,0 600,0	600,0 600,0	500,1 0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de agosto de 2018	1 800,0	1 500,0	600,0	500,1	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 18 al 21 de setiembre de 2018	1 800,0	1 650,0	600,0	600,0	0,0
v. Subasta de Colocación de Bonos del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento	2 800,0	2 800,0	2 800,0	2 800,0	2 800,0
Tasas de interés Mínima	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Coto-TP el 24 de octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Coto-TP del 18 al 21 de setiembre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Resuñales del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 18 al 21 de setiembre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reacuar)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento	4 608,0	4 608,0	4 608,0	4 608,0	4 608,0
Tasas de interés Mínima	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Máxima	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 24 de agosto de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO del 18 al 21 de setiembre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Ecasuar)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento	450,0	450,0	450,0	450,0	450,0
Tasas de interés Mínima	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Máxima	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Próximo vencimiento de Repo Ecasuar el 14 de setiembre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Ecasuar del 18 al 21 de setiembre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento	1 800,0	1 800,0	1 800,0	1 800,0	1 800,0
Tasas de interés Mínima	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 24 de agosto de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 18 al 21 de setiembre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento	1 400,0	1 400,0	1 400,0	1 400,0	1 400,0
Tasas de interés Mínima	800,0	800,0	800,0	800,0	800,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 18 octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Venta del 18 al 21 de setiembre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 18 al 21 de setiembre de 2018	0,0	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\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	127,9	18,0	4,8		1,9
iv. 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	2 414,8	2 900,6	2 918,0	1 934,0	1 381,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compras temporales de moneda extranjera (Isowar)	0,0076%	0,0076%	0,0076%	0,0076%	0,0076%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por realización monetaria en moneda nacional	66,7	0,0	234,6	522,3	159,0
d. Débitos Overnight en moneda nacional	1 520,6	1 520,6	1 520,6	1 520,6	1 520,6
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	2 486,1	2 600,6	1 783,4	1 381,7	1 232,2
i. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 033,3	7 354,1	7 336,0	7 323,4	7 323,1
ii. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,6	5,8	5,5	5,4	5,4
iii. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 971,9	2 923,1	2 974,5	2 789,0	2 722,0
iv. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,1	2,1	2,0	1,9	1,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CD BCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	967,5	664,0	1 117,5	1 117,5	1 270,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2.752.752/75	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\$)	62,8	155,0	66,5	66,5	91,5
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 CD BCRP / CD BCRP-NR y CDV	50,0	50,0	50,0	50,0	47,2
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	50,0 / 2,53				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	14 Setiembre 18	17 Setiembre 18	18 Setiembre 18	19 Setiembre 18	20 Setiembre 18
a. Plazo de la posición (abcde) = a + b + c + e + f + g	-31,2	-29,5	-23,3	-23,3	-13,1
b. Plazo de la posición corriente = a + b + c + e + f + g	-4,3	-17,4	-21,1	-21,1	-45,0
c. Mercado spot con el público	-19,6	-43,2	-48,4	-23,7	-50,7
i. (f) Ventas	240,5	188,4	216,8	230,7	271,1
ii. (g) Ventas	47,9	231,6	237,2	264,4	321,8
iii. (h) Ventas	130,3	198,0	191,7	128,8	118,3
iv. (i) Ventas	83,3	227,9	274,4	265,4	265,8
v. (j) Ventas	72,6	18,8	-101,3	86,5	-192,2
vi. (k) Ventas	163,6	97,8	274,1	272,4	214,1
vii. (l) Ventas	91,0	38,3	38,3	165,9	506,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	935,0	866,2	841,7	1019,9	1279,7
ii. A futuro	190,0	190,0	190,0	190,0	190,0
iii. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	21,0	-76,5	138,0	144,2	248,1
iv. Compras	88,0	88,0	88,0	88,0	498,4
v. (f) Ventas	67,3	126,5	249,9	38,5	291,3
vi. (g) Ventas	1,3	1,8	1,8	4,8	1,4
vii. (h) Ventas	0,6	-12,4	4,2	0,4	-1,7
viii. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
ix. Operaciones netas con instituciones financieras en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,3144	3,3136	3,3060	3,3028	3,2982
(*) Datos preliminares					