

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Miles de S/)

	22 Octubre 18	23 Octubre 18	24 Octubre 18	25 Octubre 18	26 Octubre 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 310,6	842,1	442,1	1 510,4	1 665,6
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Deudados del BCRP (CD BCRP)	50,0	0,0	50,0	50,0	200,0
Recechos recibidos	377,9	176,9	176,9	176,9	659,6
Plazo de vencimiento	171,4	526,4	342,4	342,4	74,4
Tasas de interés Máxima	2,59	2,59	2,59	2,52	2,47
Máxima	1,62	3,02	2,58	2,58	2,55
Promedio	2,81	3,02	2,86	2,82	2,52
Saldo	26 229,6	26 249,6	26 249,6	26 249,6	26 054,6
Promedio vencimiento de CD BCRP al 4 de setiembre de 2018	30,0	30,0	30,0	30,0	2 102,0
Vencimiento de CD BCRP al 24 de octubre de 2018	300,0	400,0	300,0	200,0	500,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	300,0	400,0	300,0	200,0	540,0
Procesos recibidos	1,4	1,4	1,4	1,4	10,4
Plazo de vencimiento	2,81	2,80	3,01	3,16	2,78
Tasas de interés Máxima	2,81	2,80	3,01	3,16	3,08
Máxima	2,81	1,91	1,56	1,56	7,88
Promedio	5 000,0	5 100,0	5 000,0	4 900,0	5 200,0
Saldo	300,0	300,0	300,0	300,0	500,0
Promedio vencimiento de Repo de Valores al 21 de diciembre de 2018	n/n	n/n	n/n	n/n	n/n
iii. Subasta de Certificados de Deudados Liquidables en Dinero del BCRP (COLD BCRP)					
Vencimiento de COLD BCRP al 24 de octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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 Máxima	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
iv. Promedio vencimiento de COLD BCRP al	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Vencimiento de COLD BCRP al 24 de octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recambios de moneda extranjera (Rescatar)					
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 Máxima	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
vii. Promedio vencimiento de Desdoblado a Plazo al 17 de agosto de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Vencimiento de Desdoblado a Plazo al 24 de octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Subasta de Plazo Fijo con el Tasa de Interés Fijo					
Procesos recibidos	700,0	700,0	700,0	700,0	700,0
Plazo de vencimiento	1 130,0	954,4	470,0	1 130,0	1 130,0
Tasas de interés Máxima	4,43	4,43	4,43	4,43	4,43
Máxima	4,43	4,43	4,43	4,43	4,43
Promedio	1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0
Saldo	1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0
x. Promedio vencimiento de Coto-TP al 24 de octubre de 2018	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
xi. Vencimiento de Coto-TP al 24 de octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xii. Subasta de Certificados de Deudados Liquidables del BCRP (CDL BCRP)					
Vencimiento de CDL BCRP al 24 de octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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 Máxima	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
xiii. Promedio vencimiento de CDR BCRP al	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xiv. Vencimiento de CDR BCRP al 24 de octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Compra con compromiso de Recambios de moneda extranjera (Rescatar)					
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 Máxima	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	4 908,0	4 908,0	4 908,0	4 908,0	4 908,0
v. Promedio vencimiento de Banco Bivar al 14 de setiembre de 2018	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
vi. Vencimiento de REPO al 24 de octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recambios de moneda extranjera (Escribanía)					
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 Máxima	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	150,0	150,0	150,0	150,0	150,0
viii. Promedio vencimiento de Repo Escudador al 14 de setiembre de 2018	150,0	150,0	150,0	150,0	150,0
ix. Vencimiento de REPO Escudador al 24 de octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Compra con compromiso de Recambios de moneda extranjera (Substitución)					
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 Máxima	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	1 800,0	1 800,0	1 800,0	1 800,0	1 800,0
xi. Promedio vencimiento de Repo Substitución al 24 de agosto de 2018	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
xii. Vencimiento de REPO Substitución al 24 de octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xiii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Procesos recibidos	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Plazo de vencimiento	741,0	741,0	741,0	741,0	990,0
Tasas de interés Máxima	56,4	56,4	56,4	56,4	56,4
Máxima	1,40	1,40	1,40	1,40	1,69
Promedio	1,70	1,70	1,70	1,70	1,59
Saldo	1,81	1,81	1,81	1,81	1,77
Promedio	2 285,0	2 285,0	2 285,0	2 285,0	2 285,0
Saldo	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xiv. Promedio vencimiento de SC-Venta al 15 octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xv. Vencimiento de SC-Venta al 24 de octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xvi. Subasta de Swap Cambiario Compra 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 Máxima	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
xvii. Promedio vencimiento de SC-Compra	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xviii. Vencimiento de SC-Compra al 24 de octubre de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
c. Operaciones cambiarias en la Masa de Negociación del BCR					
i. Compra (Ingresos de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de cambio promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Venta (Ingresos de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de cambio promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Compra (Ingresos de US\$)	29,26	29,26	29,26	29,26	29,26
Tasa de cambio promedio	29,26	29,26	29,26	29,26	29,26
iv. Operaciones con el Tesoro Público (Ingresos de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Ventas (Ingresos de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-AR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra de CD BCRP y CD BCRP-AR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra de BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en BCR antes del cierre de operaciones	1 558,0	1 242,2	1 192,1	1 664,4	1 865,6
4. Operaciones monetarias del BCRP ante el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (Rescatar)	0,0105%	0,0105%	0,0105%	0,0105%	0,0095%
b. Compra temporal directa de dólares (fuera de subasta)	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	458,0	243,1	227,0	691,8	722,0
d. Deudados Operados en moneda nacional	1 500,0	1 500,0	1 500,0	1 500,0	1 500,0
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 558,0	899,1	1 139,2	1 139,2	683,6
i. Fondos de reserva en moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7 502,0	7 502,0	7 502,0	7 502,0	7 502,0
Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,5	5,5	5,4	5,4	5,4
Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2 502,0	2 502,0	2 771,5	2 771,5	2 771,5
Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	2,0	1,9	1,9	1,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 452,1	1 452,1	1 434,3	988,9	1 271,5
Tasas de interés Máxima (Máxima) Promedio	2 792 800,78	2 792 800,78	2 792 800,78	2 792 800,78	2 802 502,84
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (Ingresos de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés Máxima (Máxima) Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
c. Transacciones monetarias de FOMENTO (FOMENTO u FTV)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo 12 meses (Ingreso) / Tasa (promedio)	0,0	0,0	0,0	0,0	2 252 252,25
Plazo 18 meses (Ingreso) / Tasa (promedio)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (Ingresos de US\$)	19 Octubre 18	22 Octubre 18	23 Octubre 18	24 Octubre 18	25 Octubre 18
a. Plazo de la posición inicial: $a = b + c + d + e + f + g$	16,1	16,1	16,1	16,1	16,1
Plazo de la posición contable: $a = b + c + d + e + f + g$	-90,3	-92,9	-92,9	-31,1	-257,7
b. Mercado spot con el exterior	-200,0	-200,0	-200,0	-71,5	-102,8
i. Comercial	248,5	207,0	207,0	207,0	207,0
ii. (i) Ventas	248,5	254,2	254,2	219,3	356,5
iii. Compra	153,9	8,9	8,9	8,9	61,5
iv. Paradas	162,0	184,4	184,4	87,8	138,0
v. (i) Ventas	14,1	132,3	132,3	132,3	168,6
vi. Ventas forward al público (con o sin entrada)	41,7	4,1	4,1	4,1	177,9
vii. Paradas	29,1	268,7	268,7	268,7	141,4
viii. (i) Ventas	31,3	268,8	268,8	268,8	305,5
ix. Mercado cambiario interbancario	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
c. Mercado cambiario	842,8	601,4	601,4	601,4	601,4
d. A futuro	4,0	4,0	4,0	4,0	4,0
e. Operación con asociados a swap y vencimientos de forward sin entrega	20,1	14,5	14,5	14,5	12,8
f. Compra	26,3	29,2	29,2	27,4	26,8
g. (i) Ventas	0,3	14,7	14,7	206,4	162,2
h. Efecto de Operación	2,2	0,2	0,2	4,2	2,5
i. Operaciones netas con otras instituciones financieras	1,8	-8,8	-8,8	70,5	-65,8
ii. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Nota: Tasa de cambio (promedio) (Fuente: Dinecra)	3 330,1	3 332,0	3 327,1	3 349,6	3 349,2
(*) Datos preliminares.					