

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	17 Diciembre 18	18 Diciembre 18	19 Diciembre 18	20 Diciembre 18	21 Diciembre 18
I. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	4 963,0	3 797,5	3 395,9	2 856,9	1 346,0
II. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias estructuradas del BCRP					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	50,0	200,0	200,0	50,0	500,0
Procesos recibidos	276,0	531,5	369,0	164,0	400,0
Plazo de vencimiento	178,0	351,4	178,0	53,9	348,4
Tasas de Inter. Miens	2,72	2,84	2,75	2,98	3,15
Miensa	2,75	2,80	2,75	2,80	2,85
Promedio	2,74	2,87	2,77	2,89	3,15
Saldo	26 462,0	26 760,0	26 810,8	26 865,8	26 885,8
Préstamo vencimiento de CD BCRP al 06 de diciembre de 2018	620,0		620,0		620,0
Vencimiento de CD BCRP al 27 al 30 de noviembre de 2018	0,0		0,0		0,0
ii. Subasta de Compras Temporales de Valores (REPO)					
Procesos recibidos					400,0
Plazo de vencimiento					400,0
Tasas de Inter. Miens					4,15
Miensa					4,15
Promedio					3,15
Saldo	6 300,0	6 300,0	6 300,0	6 300,0	7 050,0
Vencimiento de REPO al 27 al 30 de noviembre de 2018	200,0		200,0		1 250,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Locales del BCRP (CDD BCRP)					
Procesos recibidos					1 400,0
Plazo de vencimiento					1 400,0
Tasas de Inter. Miens					3,15
Miensa					3,15
Promedio					1,14
Saldo	6 300,0	6 300,0	6 300,0	6 300,0	7 050,0
Vencimiento de CDD BCRP al 27 al 30 de noviembre de 2018	200,0		200,0		1 250,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Locales del BCRP (CDD BCRP)					
Procesos recibidos					1 400,0
Plazo de vencimiento					1 400,0
Tasas de Inter. Miens					3,15
Miensa					3,15
Promedio					1,14
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	300,0
Vencimiento de CDD BCRP al 27 al 30 de noviembre de 2018	0,0		0,0		300,0
v. Subasta de Certificados de Depósitos de Pago en Moneda Nacional					
Procesos recibidos	300,0	1 443,0	900,1	1 150,0	1 150,0
Plazo de vencimiento	411,0	1 443,0	1 025,4	1 466,8	1 466,8
Tasas de Inter. Miens	0,6	1,4	1,4	2,10	2,10
Miensa	2,34	2,10	2,49	2,70	2,70
Promedio	2,64	2,50	2,57	2,61	2,61
Saldo	1 743,0	1 443,0	1 550,0	1 460,0	300,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo al 27 al 30 de noviembre de 2018	1 443,0		1 250,0		300,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos de Pago en Moneda Nacional					
Procesos recibidos					600,0
Plazo de vencimiento					1 084,0
Tasas de Inter. Miens					3,67
Miensa					4,41
Promedio					5,10
Saldo	3 300,0	3 300,0	3 300,0	3 300,0	4 668,0
Vencimiento de CDD BCRP al 27 al 30 de noviembre de 2018	500,0		500,0		1 100,0
vii. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables del BCRP (CDR BCRP)					
Procesos recibidos	0,0		0,0		500,0
Plazo de vencimiento					500,0
Tasas de Inter. Miens					5,00
Miensa					5,00
Promedio					5,00
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP al 27 al 30 de noviembre de 2018	0,0		0,0		0,0
viii. Compra con compromiso de Reconocimiento de moneda extranjera (Reacurar)					
Procesos recibidos					0,0
Plazo de vencimiento					0,0
Tasas de Inter. Miens					0,0
Miensa					0,0
Promedio					0,0
Saldo	5 408,0	5 408,0	5 408,0	5 408,0	5 408,0
Vencimiento de REPO al 27 al 30 de noviembre de 2018	55,0		55,0		55,0
ix. Compra con compromiso de Reconocimiento de moneda extranjera (Excanar)					
Procesos recibidos					0,0
Plazo de vencimiento					0,0
Tasas de Inter. Miens					0,0
Miensa					0,0
Promedio					0,0
Saldo	150,0	150,0	150,0	150,0	150,0
Vencimiento de REPO Excanar al 27 al 30 de noviembre de 2018	150,0		150,0		150,0
x. Compra con compromiso de Reconocimiento de moneda extranjera (Isubstituir)					
Procesos recibidos					0,0
Plazo de vencimiento					0,0
Tasas de Inter. Miens					0,0
Miensa					0,0
Promedio					0,0
Saldo	1 800,0	1 800,0	1 800,0	1 800,0	1 800,0
Vencimiento de REPO Isubstituir al 8 de febrero de 2019	200,0		200,0		200,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Varios del BCRP					
Procesos recibidos					0,0
Plazo de vencimiento					0,0
Tasas de Inter. Miens					0,0
Miensa					0,0
Promedio					0,0
Saldo	3 490,0	3 190,0	3 190,0	3 190,0	2 990,0
Vencimiento de SC-Venta al 04 diciembre de 2018	360,0		600,0		30,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Procesos recibidos					0,0
Plazo de vencimiento					0,0
Tasas de Inter. Miens					0,0
Miensa					0,0
Promedio					0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC-Compra al 27 al 30 de noviembre de 2018	0,0		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Masa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,00	7,50	0,00	0,00	0,00
i. Fomeros (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de BCRP: CD BCRP-NR v BTP					
i. Fomeros de CD BCRP-NR v BTP					
ii. Compras de BTP					
III. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2 770,8	2 897,2	2 898,9	2 856,9	2 356,0
IV. Operaciones monetarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Compra monetaria de moneda extranjera (pasivos)	0,0105%	0,0105%	0,0105%	0,0105%	0,0105%
Comisión tasa efectiva detall					
b. Compra monetaria de valores (pasivos de subasta)					
Tasa de interés	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por liquidación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	192,6	383,0	6,0	1 632,6	1 632,6
d. Depósitos Operativos en moneda nacional					
Tasa de interés	1 526,0	1 526,0	1 526,0	1 526,0	1 526,0
V. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	2 577,4	2 514,4	2 898,9	2 573,4	1 833,4
i. Fondo de encaje en moneda nacional (promedio acumulado) (millones de S/)	5,8	5,8	4 425,0	5,7	8 542,0
ii. Fondo de encaje en moneda nacional (promedio acumulado) (% del TOSE) (*)	3 050,3	3 064,4	3 396,4	3 327,6	3 267,7
iii. Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado) (millones de S/)	2,4	2,3	2,3	2,2	2,2
VI. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de BCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	909,3	1 250,9	1 425,2	740,3	613,5
Tasas de Inter. Miens (Miensa) Promedio	2 762 752,75	2 762 752,75	2 762 752,75	2 762 752,75	2 762 752,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	48,0	26,0	45,0	20,0	20,0
Tasas de Inter. Miens (Miensa) Promedio	2 252 252,25	2 252 252,25	2 252 252,25	2 252 252,25	2 252 252,25
c. Total monedas extranjeras (FOMOP - FOMOPAB v FTV)	n.n	n.n	n.n	n.n	n.n
d. Plazo 12 meses (moneda / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (moneda / tasa promedio)					
VII. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	14 Diciembre 18	17 Diciembre 18	18 Diciembre 18	19 Diciembre 18	20 Diciembre 18
Flujo de la posición inicial = a + b + c + d + e + f + g	3,9	-0,0	12,1	-12,1	27,5
Flujo de la posición contable = a + b + c + d + e + f + g	188,4	-2,0	24,3	-77,3	184,7
a. Mercado spot en el cobro	182,2	18,3	46,1	-46,1	168,8
i. Contratos	471,0	388,0	388,0	388,0	400,0
ii. Ventas	288,8	244,0	341,5	472,7	260,8
iii. Compras	51,2	44,0	11,0	-11,0	-30,0
b. Placados	158,8	87,2	18,8	-11,1	184,0
i. (i) Ventas	107,1	208,4	184,0	221,1	270,2
ii. Ventas forward al rublo (con v sin entrega)	47,9	-18,4	-14,7	-78,4	0,0
iii. Bonos	363,0	100,9	146,4	146,4	177,8
j. (i) Ventas	197,9	346,7	386,1	226,1	317,4
ii. Al contado	425,0	460,0	460,0	460,0	600,0
iii. A futuro	45,0	15,0	38,0	38,0	20,0
iv. Operaciones asociadas a swaps / vencimientos de forward sin entrega	97,4	21,2	0,0	0,0	0,0
c. Efecto de Depósitos	195,2	340,1	385,8	226,3	318,8
i. (i) Ventas	97,8	218,8	146,0	217,3	282,2
ii. Compras	-2,2	0,0	-1,1	-0,5	-0,5
d. Operaciones relacionadas con otras instituciones financieras	-178,7	-36,6	0,0	0,0	0,0
e. Crédito por liquidación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio (interbancario promedio) (Fuente: Diálogo)	3 351,6	3 342,6	3 343,0	3 350,0	3 344,4
(*) Datos preliminares					