

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	04 Marzo 19	05 Marzo 19	06 Marzo 19	07 Marzo 19	08 Marzo 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 425,1	3 533,3	4 089,0	5 114,1	3 852,3
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	50,0	200,0
Plazo de vencimiento	251,0		205,0	254,0	888,0
Tasas de interés	183,4		546,4	362,4	180,4
Máxima	2,63		2,97	2,80	2,61
Promedio	2,63		2,98	2,83	2,61
Saldo	29 726,8	29 726,8	29 801,8	28 876,9	28 876,9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de marzo de 2019		1 324,9	1 324,9		1 450,1
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 15 de marzo de 2019		350,0	1 324,9		1 450,1
ii. Subasta de Contratos Temporales de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	500,0	1100,0	350,0	200,0	200,0
Plazo de vencimiento	700,0	3000,0	1050,0	600,0	400,0
Tasas de interés	184,4	1,4	1,4	3,4	3,4
Máxima	3,96	2,83	2,91	3,01	2,76
Promedio	4,03	2,86	2,99	3,01	2,76
Saldo	6 250,0	5 200,0	5 050,0	4 850,0	5 050,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 11 de marzo de 2019		350,0	200,0		200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 11 al 15 de marzo de 2019		350,0	200,0		200,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 11 al 15 de marzo de 2019					
Vencimiento de CDLD BCRP del 11 al 15 de marzo de 2019					
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas				459,5	459,5
Plazo de vencimiento				1,4	1,4
Tasas de interés				2,26	2,26
Máxima				2,75	2,75
Promedio				4,45	2,45
Saldo	128,0	0,0	0,0	459,5	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 8 de marzo de 2019		0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 11 al 15 de marzo de 2019		0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 700,0	4 700,0	4 700,0	4 700,0	4 700,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 2 de marzo de 2019		300,0	300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 11 al 15 de marzo de 2019		0,0	0,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Resustituidos del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 11 al 15 de marzo de 2019		0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 11 al 15 de marzo de 2019		0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas	500,0	300,1	0,0		
Plazo de vencimiento	2053,0	1247,0			
Tasas de interés	366,4	366,4			
Máxima	4,09	4,10			
Promedio	4,20	4,15			
Saldo	7 253,0	7 553,1	7 553,1	7 553,1	7 553,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de marzo de 2019		600,0	600,0		600,0
Vencimiento de REPO del 11 al 15 de marzo de 2019		0,0	0,0		0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 11 al 15 de marzo de 2019		0,0	0,0		0,0
Vencimiento de REPO Expansion del 11 al 15 de marzo de 2019		0,0	0,0		0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 300,0	1 300,0	1 300,0	1 300,0	900,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 22 de marzo de 2019		400,0	400,0		400,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 11 al 15 de marzo de 2019		400,0	400,0		0,0
x. Subasta de Swaps Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 al 15 de marzo de 2019		0,0	0,0		0,0
Vencimiento de SC-Venta del 11 al 15 de marzo de 2019		0,0	0,0		0,0
xi. Subasta de Swaps Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra el 11 al 15 de marzo de 2019		0,0	0,0		0,0
Vencimiento de SC-Compra del 11 al 15 de marzo de 2019		0,0	0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neocación 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					
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	4 475,1	4 183,3	4 239,0	4 404,6	4 052,3
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%	0,0076%	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 regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,0	5,0	5,0	5,0	400,0
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4 470,1	4 178,3	4 234,0	4 399,6	3 852,3
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	10 510,3	10 372,6	10 194,5	10 151,0	10 151,0
g. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,8	6,8	6,6	6,6	6,6
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 937,5	4 848,1	4 884,4	4 651,7	4 620,2
i. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,2	3,2	3,1	3,0	3,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	628,0	1 241,6	1 503,1	1 503,1	1 486,7
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	50 / 2,62				
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	01 Marzo 19	04 Marzo 19	05 Marzo 19	06 Marzo 19	07 Marzo 19
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g					
a. Mercado spot con el público	2,8	87,9	24,3	78,7	168,4
i. Compras	11,4	81,8	15,2	36,0	135,4
ii. (f) Ventas	292,6	270,6	266,2	362,8	362,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	281,2	188,6	240,4	326,4	230,4
i. (f) Ventas	15,0	4,3	63,2	93,1	183,0
ii. (f) Ventas	155,7	117,5	233,5	176,3	283,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	136,7	113,1	110,3	83,2	466,9
i. (f) Ventas	11,3	122,8	72,0	108,8	17,1
ii. (f) Ventas	349,7	274,3	274,3	285,6	784,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias	338,4	151,5	258,3	184,4	801,7
i. Al contado	283,4	413,4	468,7	486,0	746,3
ii. A futuro	63,0	91,0	95,0	95,0	97,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	197,8	45,3	105,3	136,1	365,2
i. Compras	287,2	146,9	254,2	184,2	796,7
ii. (f) Ventas	89,4	101,5	149,1	103,5	430,5
f. Efecto de Opciones	-0,3	-1,0	0,4	0,4	-0,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-7,6	-0,8	-0,8	-11,1	4,6
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datacel)	3,3061	3,3107	3,3116	3,3083	3,3097
(*) Datos preliminares					