

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	15 Julio 19	16 Julio 19	17 Julio 19	18 Julio 19	19 Julio 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 277,0	3 715,8	3 215,3	2 824,0	1 687,6
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias financieras del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	50,0	100,0	50,0	50,0	0,0
Procesos recibidos	311,0	642,0	296,5	296,5	296,5
Plazo de vencimiento	176,0	722,0	538,0	538,0	360,0
Tasas de Interés Mínima	2,43	2,46	2,46	2,46	2,46
Máxima	2,50	2,69	2,54	2,45	2,50
Promedio	2,49	2,54	2,45	2,45	2,50
Saldo	26 218,4	26 218,4	26 234,4	26 309,4	26 369,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 2 de agosto de 2019	2 078,1	2 078,1	2 078,1	2 078,1	2 078,1
Vencimiento de CD BCRP del 22 al 26 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Comera Temporal de Valores (REPO)					
Procesos recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 700,0	5 700,0	5 700,0	5 700,0	6 200,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 22 de julio de 2019	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de REPO BCRP del 22 al 26 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Operaciones cambiarias					
Procesos recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 22 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 22 al 26 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Procesos recibidos	650,0	1 200,0	1 000,1	300,0	0,0
Plazo de vencimiento	1 287,0	2 196,8	1 740,0	819,5	0,0
Tasas de Interés Mínima	1,4	1,4	1,4	1,4	1,4
Máxima	2,0	2,0	2,09	1,89	2,0
Promedio	2,01	2,05	2,16	2,16	2,03
Saldo	650,0	1 200,0	1 000,1	300,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	650,0	1 200,0	1 000,1	300,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 22 al 26 de julio de 2019	650,0	1 200,0	1 000,1	300,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Procesos recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 100,1	4 100,1	4 100,1	4 100,1	4 100,1
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 24 de octubre de 2019	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 22 al 26 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Resaltados del BCRP (CDR BCRP)					
Procesos 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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 22 al 26 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Comera con compromiso de Reconoma de moneda extranjera (Resubar)					
Procesos recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 750,1	11 750,1	11 750,1	11 750,1	11 750,1
Próximo vencimiento de Repo Resubar el 26 de setiembre de 2019	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de REPO del 22 al 26 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Comera con compromiso de Reconoma de moneda extranjera (Ereparan)					
Procesos recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Ereparan	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Ereparan del 22 al 26 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Comera con compromiso de Reconoma de moneda extranjera (Sustitución)					
Procesos recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 22 al 26 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Procesos recibidos					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 22 de julio de 2019	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de SC-Venta del 22 al 26 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Procesos 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	0,0
Vencimiento de SC-Compra del 22 al 26 de julio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Comera (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\$)	0,0	11,0	0,0	0,0	0,0
i. Comera (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. Comera de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Comera de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2 377,0	2 315,8	2 166,3	2 474,0	2 187,6
4. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. Comera temporal de moneda extranjera (resubar)	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0087%
Comera (tasa efectiva diaria)					
b. Comera temporal directa de valores (tasa de subasta)	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
Tasa de interés					
c. Crédito por resubar monetaria en moneda nacional	609,5	537,0	526,0	801,0	514,0
Tasa de interés	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 767,4	1 778,8	1 639,3	1 673,0	1 673,6
Saldo	1 767,4	1 778,8	1 639,3	1 673,0	1 673,6
Próximo vencimiento de SC-Venta el 22 de julio de 2019	8 550,0	8 764,1	8 693,0	8 774,4	8 500,0
Vencimiento de SC-Venta del 22 al 26 de julio de 2019	5,8	5,7	5,7	5,6	5,5
Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3 573,7	3 428,0	3 354,2	3 240,0	3 155,3
Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,3	2,2	2,1	2,1	2,1
Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)					
5. Mercado monetario y mercado secundario de COBICAP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 600,0	1 467,3	1 634,8	2 241,4	1 327,9
Tasas de Interés Mínima / Máxima / Promedio	2 752 752,75	2 752 752,75	2 752 802,76	2 752 802,76	2 752 802,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de Interés Mínima / Máxima / Promedio					
c. Total mercado secundario de COBICAP, COBICAP-NR y CDV	0,0	5,0	2 502 502,50		617,2
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
6. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	12 Julio 19	15 Julio 19	16 Julio 19	17 Julio 19	18 Julio 19
Flujo de la posición global: a = b1 + c1 + e1 + f1 + g	20,0	15,1	27,4	49,3	14,4
Flujo de la posición corriente: a + b1 + c1 + e1 + f1 + g	171,8	225,1	173,1	111,7	63,3
Flujo de la posición pasiva: a + b1 + c1 + e1 + f1 + g	151,8	210,0	145,7	62,0	48,9
i. Compras	395,2	449,3	267,1	330,9	376,8
ii. Ventas	260,4	293,3	179,1	221,2	259,7
iii. (i) Ventas	87,9	26,7	37,9	128,0	5,0
b. Compras forwards y swap al público (con y sin entrega)	267,7	292,6	159,2	207,8	173,7
c. Ventas forwards y swap al público (con y sin entrega)	164,1	276,5	197,1	73,8	178,7
d. Ventas forwards y swap al público (con y sin entrega)	267,7	216,8	19,2	86,1	84,4
iii. Facturas	431,6	591,2	315,3	234,3	488,1
iv. Ventas	148,8	386,4	286,1	147,6	516,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al igual	771,2	841,0	543,2	665,3	597,0
ii. Al revés	19,2	36,1	76,0	88,3	140,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	146,7	146,2	173,1	342,4	342,4
f. Compras	126,4	395,3	294,2	142,9	499,4
g. Ventas	14,3	22,8	171,1	19,5	197,1
h. Efecto de Docenas	1,4	0,7	1,0	1,7	1,7
i. Operaciones netas con otras instituciones financieras	2,4	12,1	12,3	1,6	1,6
h. Crédito por repatriación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio: Interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2856	3,2857	3,2870	3,2856	3,2873
1. Tipo de cambio					