BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	22 Julio 19	23 Julio 19	24 Julio 19	25 Julio 19	26 Julio 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**700,7**	**1 300,0**	**1 833,4**	**1 748,7**	**1 985,4**
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)	50.0		50.0	50.0	
Provuestas recibidas	150.0		368.0	360.0	
Plazo de vencimiento	169 d		531 d	376 d	
Tasas de interes Mínima	2.42		2.43	2.35	
Máxima	2.48		2.45	2.49	
Promedio	2.46		2.44	2.46	
Saldo	26 444.4	26 444.4	26 519.4	26 594.4	26 594.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 2 de agosto de 2019	2 079.1		2 079.1	2 079.1	
Vencimiento de CD BCRP del 29 de julio al 2 de agosto del 2019	0.0		0.0	2 079.1	
ii. Subasta de Comora Temporal de Valores (REPO)	600.0 600.0	400.0 400.0	160.0 200.0	200.0	250.0
Provuestas recibidas	1250.0 1300.0	800.0 550.0	160.0 200.0	400.0	250.0
Plazo de vencimiento	14 d 1 d	14 d 1 d	14 d 1 d	1 d	7 d
Tasas de interes Mínima	3.0 2.85	3.06 3.0	3.05 2.80	3.06	2.85
Máxima	3.0 2.90	3.06 3.0	3.05 2.80	3.06	2.85
Promedio	3.0 2.87	3.06 3.0	3.05 2.80	3.06	2.85
Saldo	6 900.0	7 100.0	7 060.0	7 060.0	7 110.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 26 de julio de 2019	600.0		200.0	200.0	
Vencimiento de REPO BCRP del 29 de julio al 2 de agosto del 2019	600.0		200.0	500.0	
Provuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interes Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	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 29 de julio al 2 de agosto del 2019	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Provuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interes Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	0.0		0.0	0.0	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 29 de julio al 2 de agosto del 2019	0.0		0.0	0.0	
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Provuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interes 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	
Vencimiento de Coloc-TP del 29 de julio al 2 de agosto del 2019	0.0		0.0	0.0	
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables del BCRP (CDR BCRP)					
Provuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interes 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	
Vencimiento de CDR BCRP del 29 de julio al 2 de agosto del 2019	0.0		0.0	0.0	
vii. Comora con comoromiso de Recomora de moneda extraniera (Regular)					
Provuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interes Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 750.1	11 750.1	11 750.1	11 750.1	11 750.1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 26 de setiembre de 2019	600.0		600.0	600.0	
Vencimiento de REPO del 29 de julio al 2 de agosto del 2019	0.0		0.0	0.0	
viii. Comora con comoromiso de Recomora de moneda extraniera (Expansión)					
Provuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interes Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Expansion	0.0		0.0	0.0	
Vencimiento de REPO Expansión del 29 de julio al 2 de agosto del 2019	0.0		0.0	0.0	
ix. Comora con comoromiso de Recomora de moneda extraniera (Sustitución)					
Provuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interes Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion	0.0		0.0	0.0	
Vencimiento de REPO Sustitución del 29 de julio al 2 de agosto del 2019	0.0		0.0	0.0	
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Provuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interes Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Venta					
Vencimiento de SC - Venta del 29 de julio al 2 de agosto del 2019	0.0	0.0	0.0	0.0	
xi. Subasta de Swap Cambiario Comora del BCRP					
Provuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interes Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Comora	0.0		0.0	0.0	
Vencimiento de SC - Comora del 29 de julio al 2 de agosto del 2019	0.0		0.0	0.0	
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Comoras (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$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Comoras (millones de US$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Comoras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Comoras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**1 900,7**	**2 100,0**	**2 143,4**	**1 898,7**	**2 235,4**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Comora temporal de moneda extraniera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0077%	0.0076%	0.0076%	0.0076%	0.0086%
b. Comora temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	315.4	473.0	258.1	224.9	1 016.8
Tasa de interés	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 585,3**	**1 627,0**	**1 885,3**	**1 673,8**	**1 218,6**
i Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8 297,4	8 234,9	8 181,3	8 152,5	8 103,3
I Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,4	5,4	5,3	5,3	5,3
i Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 956,8	2 895,1	2 842,3	2 814,3	2 762,3
ii Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,9	1,9	1,9	1,8	1,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 001,0	1 154,5	657,0	676,0	551,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75
b. Operaciones a la vista en moneda extraniera (millones de US$)		49,0	12,0	20,0	20,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio		2.50/2.50/2.50	2.50/2.50/2.50	2.50/2.50/2.50	2.50/2.50/2.50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV		5,0			
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**19 Julio 19**	**22 Julio 19**	**23 Julio 19**	**24 Julio 19**	**25 Julio 19**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	64,1	-128,3	-12,6	-61,8	95,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	80,1	34,7	-107,9	-25,5	-7,6
a. Mercado spot con el público	48,4	30,7	-122,5	-24,0	-21,3
i. Compras	313,6	282,0	328,4	398,8	474,2
ii (-) Ventas	265,2	251,3	450,9	420,8	495,5
b. Comoras forward y swap al público (con y sin entrega)	-49,3	93,5	84,3	107,4	-22,5
i. Pactadas	142,4	236,7	313,2	268,4	363,3
ii (-) Vencidas	191,7	143,3	118,9	161,0	385,8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-91,4	165,3	96,0	149,5	-190,3
i. Pactadas	182,1	468,3	411,8	265,0	600,3
ii (-) Vencidas	273,3	302,8	166,7	121,4	731,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	370,2	352,1	636,3	641,8	653,1
ii. A futuro	20,0	5,0	23,0	6,0	73,0
e. Operaciones sect asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	113,1	163,1	56,4	-18,4	358,9
i. Compras	269,3	275,7	140,7	120,7	703,8
ii (-) Ventas	156,2	112,6	84,2	139,1	344,9
f. Efecto de Opciones	1,9	-1,5	-3,9	-1,2	-5,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,1	-89,2	6,0	-22,7	0,1
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2836	3,2848	3,2914	3,2929	3,2989

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera