BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	12 Ago 19	13 Ago 19	14 Ago 19	15 Ago 19	16 Ago 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**7 580,4**	**7 252,5**	**5 967,2**	**5 656,3**	**4 253,2**
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)	50.0 250.0 250.0 250.0	200.0 200.0 300.0 300.0	50.0 300.0 400.0	50.0 200.0 200.0	200.0
Prouestas recibidas	50.0 850.0 863.0 971.0	500.0 753.0 991.0 1052.0	231.0 1109.0 1353.0	225.4 461.0 706.0	411.0
Plazo de vencimiento	178 d 722 d 540 d 398 d	721 d 539 d 357 d 177 d	538 d 356 d 176 d	355 d 537 d 355 d	354 d
Tasas de inte Mínima	2.17 2.24 2.23 2.22	2.26 2.24 2.23 2.22	2.25 2.27 2.24	2.29 2.31 2.31	2.31
Máxima	2.25 2.24 2.28 2.25	2.26 2.27 2.31 2.26	2.30 2.31 2.26	2.31 2.33 2.33	2.35
Promedio	2.22 2.24 2.25 2.24	2.26 2.26 2.27 2.25	2.28 2.29 2.25	2.31 2.32 2.31	2.33
Saldo	25 963.2	26 977.2	27 837.2	27 663.6	27 863.6
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de setiembre de 2019	675.0	675.0	675.0	1 601.0	1 601.0
Vencimiento de CD BCRP del 19 al 23 de agosto del 2019	675.0	675.0	675.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Comora Temporal de Valores (REPO)					
Prouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 900.0	4 900.0	4 900.0	4 900.0	4 900.0
Próximo vencimiento de Reoo de Valores el 22 de agosto de 2019	400.0	400.0	400.0	400.0	400.0
Vencimiento de REPO BCRP del 19 al 23 de agosto del 2019	0.0	0.0	0.0	400.0	400.0
Prouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte 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 19 al 23 de agosto del 2019	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Deoósitos a Plazo en Moneda Nacional	1000.0 2700.0	1000.0 1744.0	1000.0 1600.0	1000.0 400.0 1600.0	500.0 2000.0
Prouestas recibidas	1394.0 3650.1	1493.0 1744.0	1635.0 2859.4	1945.0 1135.6 2142.2	1060.0 2520.3
Plazo de vencimiento	3 d 3 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 7 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de inte Mínima	2.07 1.85	2.00 2.00	2.39 2.10	2.15 2.0 2.0	2.09 2.09
Máxima	2.17 1.85	2.47 2.50	2.48 2.35	2.30 2.44 2.43	2.31 2.18
Promedio	2.10 1.85	2.37 2.42	2.43 2.32	2.26 2.41 2.32	2.25 2.11
Saldo	2 757.1	2 744.0	2 600.0	3 000.0	2 900.0
Próximo vencimiento de Deoósitos a Plazo el 19 de agosto de 2019	2 757.1	2 744.0	2 600.0	2 600.0	2 500.0
Vencimiento de Deoósitos a Plazo del 19 al 23 de agosto del 2019	2 757.1	2 744.0	2 600.0	3 000.0	2 900.0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Prouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte 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 19 al 23 de aoosto del 2019	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
vi. Subasta de Certificados de Deoósitos Realustables del BCRP (CDR BCRP)					
Prouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte 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 19 al 23 de aoosto del 2019	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
vii. Comora con compromiso de Recompora de moneda extraniera (Reoular)					
Prouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 750.1	11 750.1	11 750.1	11 750.1	11 750.1
Próximo vencimiento de Reoo Reoular el 26 de setiembre de 2019	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de REPO del 19 al 23 de aoosto del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Comora con comprornriso de Recompora de moneda extraniera (Expansión)					
Prouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Reoo Expansion	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Expansión del 19 al 23 de aoosto del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Comora con comprornriso de Recompora de moneda extraniera (Sustitución)					
Prouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Reoo Sustitucion	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 19 al 23 de aoosto del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swao Cambiario Venta del BCRP	300,0		300,0 300,0		
Prouestas recibidas	365,0		1015,0 816,0 376,0		
Plazo de vencimiento	60 d		58 d 62 d 62 d		
Tasas de inte Mínima	1,10		0,90 0,98 1,00		
Máxima	1,90		1,09 1,24 1,20		
Promedio	1,41		0,98 1,07 1,14		
Saldo	1 500.1	1 500.1	2 400.1	2 400.1	2 400.1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 4 de octubre de 2019	600,1	600,1	600,1	600,1	600,1
Vencimiento de SC - Venta del 19 al 23 de aoosto del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swao Cambiario Comora del BCRP					
Prouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte 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	0.0	0.0
Vencimiento de SC - Comora del 19 al 23 de aoosto del 2019	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neoociación del BCR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Comoras (millones de US$)					
Tipo de cambio oromedio					
ii. Ventas (millones de US$)					
Tipo de cambio oromedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US$)	0.0	3.5	3.5		
i. Comoras (millones de US$) - Tesoro Público		3.5	3.5		
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP. CD BCRP-NR v BTP					
i. Comoras de CD BCRP v CD BCRP-NR					
ii. Comoras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las emoresas bancarias en el BCR antes del cierre de ooeraciones	**4 023,3**	**3 508,5**	**2 617,2**	**2 206,3**	**1 553,2**
4. Operaciones monetarias del BCR oara el cierre de ooeraciones					
a. Comora temooral de moneda extraniera (swaos).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0074%	0.0075%	0.0074%	0.0074%	0.0084%
b. Comora temooral directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3.05%	3.05%	3.05%	3.05%	3.05%
c. Crédito oor reoulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Deoósitos Overnidt en moneda nacional	18.0	4.0	2.3	305.0	425.3
Tasa de interés	1.50%	1.25%	1.25%	1.25%	1.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**4 005,5**	**3 504,5**	**2 614,9**	**1 901,3**	**1 127,9**
ε Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9 586,5	9 568,6	9 533,3	9 380,4	9 251,1
ξ Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,1	6,1	6,1	6,0	5,9
ι Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 024,4	4 018,0	3 981,3	3 830,9	3 702,1
ι Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,6	2,6	2,5	2,4	2,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Ooeraciones a la vista en moneda nacional	481.4	648.0	1 160.0	304.7	411.7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2.50/2.50/2.50	2.50/2.50/2.50	2.50/2.50/2.50	2.50/2.50/2.50	2.50/2.50/2.50
b. Ooeraciones a la vista en moneda extraniera (millones de US$)	110.0				
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	2.05/2.10/2.09				
c. Total mercado secundario de CDBCRP. CDBCRP-NR v CDV		4.0		10.0	
Plazo 6 meses (monto / tasa oromedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa oromedio)				10.0/2.31	
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**09 Agosto 19**	**12 Agosto 19**	**13 Agosto 19**	**14 Agosto 19**	**15 Agosto 19**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-72.2	93.8	413.4	295.0	157.1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + o	-10.1	64.2	-442.7	90.8	13.9
a. Mercado spot con el público	-13.2	42.2	-472.0	79.8	-32.4
i. Compras	276.6	387.5	267.5	395.2	345.5
ii (-) Ventas	289.8	345.2	739.5	315.4	377.9
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	31.5	-25.2	52.6	27.2	-44.7
i. Pactadas	177.7	169.5	205.3	223.1	242.5
ii (-) Vencidas	146.2	194.8	152.7	195.9	287.2
c. Ventas forward v swao al público (con v sin entreoa)	95.3	79.4	21.9	82.6	-188.2
i. Pactadas	389.6	235.1	233.0	333.8	803.8
ii (-) Vencidas	294.4	155.7	211.0	251.2	992.0
d. Ooeraciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	386.0	455.7	892.1	685.2	650.5
ii. A futuro	75.0	90.0	0.0	61.5	200.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entreoa	151.9	-10.6	78.2	30.3	747.1
i. Comoras	275.0	154.3	208.6	210.8	971.3
ii (-) Ventas	123.1	164.9	130.3	180.5	224.2
f. Efecto de Oociones	1.7	1.7	-1.4	-1.6	-0.3
g. Ooeraciones netas con otras instituciones financieras	-0.6	82.1	9.4	301.2	4.0
h. Crédito por reoulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3823	3,3871	3,3781	3,3931	3,3921

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera