

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	02 Set 19	03 Set 19	04 Set 19	05 Set 19	06 Set 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 166,3	3 335,9	3 169,4	3 588,0	3 716,4
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 BCR (CD BCRP)					
Prouestas recibidas	50,0			50,0	196,0
Plazo de vencimiento	183 d			383 d	
Tasas de interés	Mínima			2,30	2,30
	Máxima			2,30	2,30
Promedio	2,29			2,31	2,31
Saldo	28 346,9	28 745,8	28 845,8	28 945,8	28 945,8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de setiembre de 2019	1 601,0	325,0	325,0	325,0	325,0
Vencimiento de CD BCRP del 9 al 13 de setiembre del 2019	1 258,0	0,0	0,0	325,0	325,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Prouestas recibidas	2577,0	1800,0	1200,0	1000,0	300,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	182 d
Tasas de interés	Mínima	2,50	2,50	2,55	3,58
	Máxima	2,91	2,85	2,86	3,62
Promedio	2,71	2,65	2,71	2,71	3,59
Saldo	7 077,0	5 600,0	4 700,0	4 500,0	4 500,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 6 de setiembre de 2019	3 077,0	2 100,0	1 200,0	1 000,0	700,0
Vencimiento de REPO BCRP del 9 al 13 de setiembre del 2019	3 977,0	2 100,0	1 200,0	1 000,0	700,0
Prouestas recibidas					
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 9 al 13 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Prouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés	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	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 9 al 13 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Prouestas recibidas					
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 9 al 13 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustados del BCRP (CDR BCRP)					
Prouestas recibidas					
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 9 al 13 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Prouestas recibidas					
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 Regular el 26 de setiembre de 2019	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de REPO del 9 al 13 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Excursión)					
Prouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés	Mínima				
	Máxima				
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Excursión	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Excursión del 9 al 13 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Prouestas recibidas					
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 9 al 13 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Prouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés	Mínima				
	Máxima				
Promedio					
Saldo	2 400,1	2 400,1	2 400,1	2 400,1	2 400,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 4 de octubre de 2019	500,1	500,1	500,1	500,1	500,1
Vencimiento de SC - Venta del 9 al 13 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Prouestas recibidas					
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 9 al 13 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipos de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipos de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	1,9	0,5		53,5	
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	1,9	0,5		53,5	
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP / 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	4 693,3	4 935,9	4 319,4	4 338,0	4 716,4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0074%	0,0074%	0,0074%	0,0076%	0,0085%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	3,05%	3,05%	3,05%	3,05%	3,05%
c. Crédito por reposición monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	0,0	5,0	4,0	6,0	273,2
d. Descalcos Overemr en moneda nacional					
Tasa de interés	1,25%	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	4 693,3	4 935,9	4 319,4	4 338,0	4 716,4
+ Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) ^(*)	8 133,3	8 958,5	9 373,2	9 332,0	9 482,9
+ Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSG) ^(*)	0,2	0,2	0,0	0,0	0,0
+ Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 603,4	3 396,0	3 839,1	3 811,3	3 967,5
+ Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSG) ^(*)	1,7	2,2	2,4	2,4	2,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 361,2	1 277,9	1 335,8	1 344,0	1 606,0
Tasas de interés: Múltiplo / Múltiplo / Promedio	2,50/2,55/2,50	2,50/2,50/2,50	2,50/2,55/2,51	2,50/2,55/2,50	2,50/2,55/2,51
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	12,5	8,0	28,5	18,5	28,5
Tasas de interés: Múltiplo / Múltiplo / Promedio	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			5,3	45,0	
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 Agosto 19	02 Setiembre 19	03 Setiembre 19	04 Setiembre 19	05 Setiembre 19
Flujo de la posición global = a + b + c + e + f + g	29,1	12,3	37,1	31,4	163,3
Flujo de la posición contable = a + b + c - d + e + f + g	29,2	-34,8	-20,0	-24,8	-28,7
a. Mercado spot con el público	54,7	35,2	56,4	95,9	87,1
i. Compras	404,1	236,4	459,6	333,7	329,2
ii. (-) Ventas	408,9	271,5	516,0	429,5	416,5
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	64,3	40,5	184,4	48,4	-160,0
i. Factadas	296,9	81,8	379,7	195,0	276,5
ii. (-) Vencidas	234,5	21,3	195,3	146,6	436,3
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	185,6	-8,3	126,6	3,1	-349,9
i. Factadas	344,9	29,7	561,2	437,3	797,5
ii. (-) Vencidas	156,2	38,1	434,5	440,5	1147,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	460,7	233,5	765,6	677,0	1096,0
ii. A futuro	150,0	0,0	188,0	148,0	43,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	7,8	15,3	26,1	37,9	70,5
i. Compras	152,2	17,4	402,9	440,1	1137,9
ii. (-) Ventas	144,4	2,1	117,7	62,2	357,6
f. Efecto de Opciones	-1,0	-1,1	-0,7	4,8	0,7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-3,1	1,8	-9,5	-13,1	-9,5
h. Crédito por reposición monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Dataflex)	3,3970	3,4030	3,4040	3,3878	3,3630
(*) Bajo preliminar					