BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	30 Julio 18	31 Julio 18	01 Agosto 18	02 Agosto 18	03 Agosto 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**402,2**	**-460,9**	**2 003,2**	**2 421,0**	**3 032,2**
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)					
Propuestas recibidas	30.0		50.0	50.0	
Plazo de vencimiento	181.0		140.0	168.5	
Tasas de inte Mínima	189.d		552.d	365.d	
Máxima	2.49		2.70	2.53	
Promedio	2.50		2.70	2.58	
Saldo	2.50		2.70	2.57	
Próximo vencimiento de CD BCRP al 06 de agosto de 2018	23 445.8	23 445.8	23 495.8	23 545.8	23 545.8
Vencimiento de CD BCRP del 02 al 03 de agosto de 2018	1 300.0	1 300.0	1 300.0	1 300.0	1 300.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Propuestas recibidas	500.0 300.0	800.0 450.0	1500.0 1000.0 1000.0	1000.0 500.0 500.0	500.0 500.0
Plazo de vencimiento	1300.0 800.0	1300.0 450.0	3400.0 2200.0 1800.0	1700.0 1000.0 1000.0	800.0 800.0
Tasas de inte Mínima	1.d 1.d	1.d 1.d	1.d 7.d 1.d	1.d 7.d 1.d	3.d 3.d
Máxima	2.90 2.80	2.91 2.75	2.86 2.76 2.75	2.77 2.75 2.75	2.75 2.75
Promedio	2.90 2.81	2.84 2.75	2.91 2.84 2.77	2.81 2.81 2.75	2.75 2.75
	2.90 2.84	2.92 2.75	2.88 2.86 2.76	2.79 2.78 2.75	2.75 2.75
Saldo	4 900.0	5 350.0	7 600.0	7 100.0	6 600.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 06 de agosto de 2018	800.0		2 500.0		1 400.0
Vencimiento de REPO BCRP del 02 al 03 de agosto de 2018	800.0		2 500.0		3 200.0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas 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
Vencimiento de CDLD BCRP del 02 al 03 de agosto de 2018	0.0		0.0		0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 02 al 03 de agosto de 2018					
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 400.0	2 400.0	2 400.0	2 400.0	2 400.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 24 de octubre de 2018	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de Coloc-TP del 02 al 03 de agosto de 2018	0.0		0.0		0.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas 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 el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 02 al 03 de agosto de 2018	0.0		0.0		0.0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reventa)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 308.0	4 308.0	4 308.0	4 308.0	4 308.0
Próximo vencimiento de Repo Reaular el 24 de agosto de 2018	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de REPO del 02 al 03 de agosto de 2018	0.0		0.0		0.0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 250.0	1 250.0	1 250.0	1 250.0	1 250.0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 14 de Setiembre de 2018	800.0		800.0		800.0
Vencimiento de REPO Expansión del 02 al 03 de agosto de 2018	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 300.0	2 300.0	2 300.0	2 300.0	2 300.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 24 de agosto de 2018	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 02 al 03 de agosto de 2018	0.0		0.0		0.0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas 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-Venta el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de SC - Venta del 02 al 03 de agosto de 2018	0.0		0.0		0.0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas 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-Compra	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de SC - Compra del 02 al 03 de agosto de 2018	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. 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	2.2	2.2	2.2	2.2	2.2
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**1 172,2**	**789,1**	**4 453,2**	**4 371,0**	**4 032,2**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0077%	0.0077%	0.0077%	0.0077%	0.0087%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	359.0	298.1	22.3	21.2	29.6
Tasa de interés	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**813,2**	**491,0**	**4 430,9**	**4 349,8**	**4 002,5**
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	7 201.8	7 214.3	9 312.9	8 150.9	9 169.4
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.2	5.2	6.4	5.6	5.6
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 335.4	2 292.7	4 430.9	4 430.9	4 288.1
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.7	1.7	3.1	2.3	3.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 123.7	1 395.6	1 028.6	1 090.0	1 090.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	20.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	2.000/2.000/2.00				
c. Total mercado secundario de CDBCRP: CDBCRP-NR y CDV	27.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**27 Julio 18**	**30 Julio 18**	**31 Julio 18**	**01 Agosto 18**	**02 Agosto 18**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-1.9	-14.3	36.0	0.3	153.4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-10.8	-135.9	-45.1	4.7	16.2
a. Mercado spot con el público	-14.8	-100.3	-76.6	-35.5	-23.6
i. Compras	44.9	300.4	259.3	223.0	315.1
ii (-) Ventas	59.7	400.7	336.0	258.5	338.7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	10.4	90.8	35.5	-9.7	-102.7
i. Pactadas	14.3	157.8	220.4	138.6	332.4
ii (-) Vencidas	4.0	67.0	184.9	148.3	435.0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	0.0	-28.8	-45.6	-5.1	-242.0
i. Pactadas	0.0	124.5	164.7	112.4	362.0
ii (-) Vencidas	0.0	153.3	210.3	117.5	604.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	0.0	877.0	683.8	696.5	719.0
ii. A futuro	0.0	0.0	96.0	14.0	66.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	0.0	57.4	54.4	23.9	211.5
i. Compras	0.0	117.6	208.1	117.0	570.7
ii (-) Ventas	0.0	60.2	153.6	93.0	359.2
f. Efecto de Opciones	-1.5	2.1	0.0	0.2	-2.1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0.0	-6.8	2.4	-14.6	-2.7
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2744	3,2694	3,2734	3,2732	3,2726

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera