

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	30 Abril 18	02 Mayo 18	03 Mayo 18	04 Mayo 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 132,7	551,3	1 210,2	1 562,9
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	50,0	50,0	50,0	
Plazo de vencimiento	260,0	125,0	308,0	
Tasas de Inter Mínima	192 d	554 d	371 d	
Máxima	2,6	2,7	2,6	
Promedio	2,6	2,7	2,6	
Saldo	27 541,5	27 591,5	27 641,5	27 641,5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 08 de mayo de 2018	1 026,1	1 026,1		1 026,1
Vencimiento de CD BCRP del 07 al 11 de mayo de 2018	0,0			0,0
ii. Subasta de Comora Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas	500,0	1000,0	2200,0	1590,0
Plazo de vencimiento	7 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de Inter Mínima	3,06	2,92	2,95	2,78
Máxima	3,11	3,15	3,02	2,91
Promedio	3,09	3,04	2,99	2,96
Saldo	2 609,9	5 809,9	5 199,9	4 659,9
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 07 de mayo de 2018	300,0	3 200,0		2 350,0
Vencimiento de REPO BCRP del 07 al 11 de mayo de 2018	300,0	3 200,0		1 750,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 07 al 11 de mayo de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 07 al 11 de mayo de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público				
Propuestas recibidas	500,0	300,0	500,0	
Plazo de vencimiento	1 026,9	768,9	768,9	
Tasas de Inter Mínima	185 d	365 d	186 d	
Máxima	2,98	3,07	2,92	
Promedio	3,35	3,05	3,25	
Saldo	2 200,0	2 500,0	3 000,0	3 000,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de junio de 2018	300,0	300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 07 al 11 de mayo 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 Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 07 al 11 de mayo de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	5 583,1	5 283,1	5 283,1	5 283,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 01 de junio de 2018	300,0	300,0		300,0
Vencimiento de REPO del 07 al 11 de mayo de 2018	300,0	0,0		0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	1 850,0	1 850,0	1 850,0	1 850,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 11 de Mayo de 2018	600,0	600,0		600,0
Vencimiento de REPO Expansión del 07 al 11 de mayo 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 Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	3 380,0	3 380,0	3 380,0	2 980,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 11 de mayo de 2018	400,0	400,0		400,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 07 al 11 de mayo de 2018	400,0	400,0		400,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				
Propuestas recibidas			400,1	
Plazo de vencimiento			870,0	
Tasas de Inter Mínima			61 d	
Máxima			0,75	
Promedio			1,75	
Saldo	0,0	0,0	1,28	400,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 03 julio 2018	0,0	0,0	400,1	400,1
Vencimiento de SC - Venta del 07 al 11 de mayo de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 07 al 11 de mayo de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio				
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)				
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. 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	972,7	4 001,3	4 350,2	3 612,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Comora temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0085%	0,0077%	0,0077%	0,0087%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	610,0			
Tasa de interés	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	255,8	0,0	6,4	41,5
Tasa de interés	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	716,9	4 001,3	4 343,8	3 571,4
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 835,9	7 201,2	7 689,0	7 513,4
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,1	5,5	6,4	5,6
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	1 993,9	2 359,1	2 359,1	2 662,2
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,5	1,8	2,3	2,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	956,9	1 326,0	929,5	1 369,5
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
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		100,0	176,5	377,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP - CDBCRP-NR y CDV	0,0	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		50,0	50,0	100,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			50,0 / 2,58	
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	27 Abril 18	30 Abril 18	02 Mayo 18	03 Mayo 18
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	20,0	-84,6	-124,5	-12,8
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	32,2	-115,7	-114,4	-34,6
a. Mercado spot con el público	12,6	-126,3	89,3	15,7
i. Compras	334,1	404,3	334,4	320,1
ii (c) Ventas	322,5	530,6	304,5	304,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	65,1	65,6	50,1	-79,7
i. Placadas	297,2	245,1	160,1	397,1
ii (c) Vencidas	212,2	212,2	110,0	475,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	36,2	38,1	287,4	-7,0
i. Placadas	237,9	242,9	386,3	469,1
ii (c) Vencidas	201,7	204,5	98,9	476,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	890,5	1051,4	1043,1	920,5
ii. A futuro	20,0	20,0	25,0	13,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-51,1	-51,1	-51,1	-57,0
i. Compras	187,8	183,7	90,4	406,0
ii (c) Ventas	192,9	152,5	82,3	462,0
f. Efecto de Opciones	0,3	3,5	-1,7	-2,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-47,1	4,5	5,9	128,1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2398	3,2502	3,2686	3,2761
(*) Datos preliminares				