

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	14 Mayo 18	15 Mayo 18	16 Mayo 18	17 Mayo 18	18 Mayo 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 605,1	4 502,3	3 431,7	2 803,9	1 858,7
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias unilaterales del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	50,0	200,0	250,0	50,0	
Plazo de vencimiento	272,0	1047,0	172,0	1324,5	261,0
Tasas de Inter Mínima	178 d	91 d	540 d	90 d	357 d
Tasas de Inter Máxima	2,54	2,50	2,68	2,54	2,58
Promedio	2,62	2,56	2,70	2,57	2,58
Saldo	2,58	2,57	2,70	2,55	2,58
Próximo vencimiento de CD BCRP el 07 de junio de 2018	26 160,4	26 104,4	26 729,4	26 644,4	26 644,4
Vencimiento de CD BCRP del 21 al 25 de mayo de 2018	506,0		160,0		904,9
Promedio	666,0		160,0		0,0
ii. Subasta de Comora Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Tasas de Inter Máxima					
Promedio					
Saldo	2 809,9	2 809,9	2 809,9	2 809,9	2 809,9
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 04 de junio de 2018	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO BCRP del 21 al 25 de mayo de 2018	0,0		0,0		0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Tasas de Inter Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 25 de mayo de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 21 al 25 de mayo de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	1 000,0	1 700,0	1 000,0	695,8	300,0
Propuestas recibidas	2 048,5	2 312,9	1 361,1	698,1	914,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	3 d	3 d
Tasas de Inter Mínima	2,12	2,18	2,20	2,20	2,25
Tasas de Inter Máxima	2,40	2,65	2,54	2,72	2,40
Promedio	2,27	2,38	2,40	2,49	2,32
Saldo	1 000,0	1 700,0	1 000,0	695,8	300,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 18 de mayo de 2018	1 000,0	1 000,0	1 000,0	300,0	300,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 21 al 25 de mayo de 2018	1 000,0		1 000,0		300,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Tasas de Inter Máxima					
Promedio					
Saldo	3 000,0	3 000,0	3 000,0	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 21 al 25 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					
Tasas de Inter Máxima					
Promedio					
Saldo	510,0	510,0	510,0	510,0	510,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 09 de julio de 2018	510,0		510,0		510,0
Vencimiento de CDR BCRP del 21 al 25 de mayo de 2018	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					
Tasas de Inter Máxima					
Promedio					
Saldo	5 283,1	5 283,1	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 21 al 25 de mayo 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 Inter Mínima					
Tasas de Inter Máxima					
Promedio					
Saldo	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 14 de Setiembre de 2018	800,0		800,0		800,0
Vencimiento de REPO Expansión del 21 al 25 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					
Tasas de Inter Máxima					
Promedio					
Saldo	2 580,0	2 580,0	2 580,0	2 580,0	2 300,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 24 de agosto de 2018	280,0		280,0		500,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 21 al 25 de mayo de 2018	280,0		280,0		
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Tasas de Inter Máxima					
Promedio					
Saldo	1 260,1	1 260,1	1 260,1	1 260,1	1 260,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 03 julio 2018	400,1		400,1		400,1
Vencimiento de SC - Venta del 21 al 25 de mayo de 2018	0,0		0,0		0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Tasas de Inter 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 21 al 25 de mayo de 2018	0,0		0,0		0,0
xii. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
Ventas (millones de US\$)					
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	13,6				
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					
e. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2 555,1	2 462,3	1 881,7	2 158,1	1 558,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Comora temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0087%
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 regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	105,0	62,2	107,0	8,7	171,0
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	2 450,1	2 340,1	1 774,7	2 149,4	1 387,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 144,7	8 187,4	8 004,9	7 895,8	7 920,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,9	5,9	5,8	5,7	5,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 212,9	3 155,8	3 069,5	3 121,9	3 025,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,3	2,4	2,2	2,1	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	877,2	985,0	1 021,4	867,0	1 216,7
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\$)	227,5	173,0	58,5	45,0	6,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75
c. Total mercado secundario de CDBCRP: CDBCRP-NR y CDV	20,0	0,0	0,0	0,0	50,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					50,0 / 2,58
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	11 Mayo 18	14 Mayo 18	15 Mayo 18	16 Mayo 18	17 Mayo 18
a. Flujo de la posición global = a + b - i - c + e + f + g	59,3	59,5	-25,0	-17,3	83,6
b. Flujo de la posición contable = a + b - i - c + e + f + g	119,5	106,5	106,5	89,2	-72,5
a. Mercado spot con el público	119,5	-85,4	23,3	-83,4	83,9
i. Compras	358,3	312,1	359,9	233,7	268,2
ii. (-) Ventas	247,8	378,6	321,6	203,9	331,4
b. Comoras forward al público (con y sin entrega)	45,7	93,0	-93,0	-32,3	-205,8
i. Pactadas	148,0	161,4	124,0	100,2	105,5
ii. (-) Vencidas	102,3	68,4	173,7	132,5	311,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	129,3	129,5	74,9	72,5	-362,1
i. Pactadas	252,1	311,1	286,0	242,4	412,3
ii. (-) Vencidas	131,6	337,8	211,0	169,9	774,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1360,1	848,1	1045,5	1012,1	1234,6
ii. A futuro	16,0	15,0	25,0	85,0	10,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	32,5	271,4	109,1	108,5	451,3
i. Compras	129,3	327,5	209,5	188,7	753,6
ii. (-) Ventas	96,8	56,1	100,4	60,0	302,3
f. Efecto de Opciones	15,2	3,4	-8,8	3,7	-0,3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	5,9	0,9	5,4	-0,7	2,6
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2598	3,2593	3,2710	3,2676	3,2735
(*) Datos preliminares					