

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	04 Junio 18	05 Junio 18	06 Junio 18	07 Junio 18	08 Junio 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 369,2	2 483,7	2 457,5	2 907,7	2 784,5
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	29,9		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	244,2		157,0	141,5	
Tasas de Intra Miriama	185,4		545,4	364,4	
Máxima	2,57		2,65	2,72	
Promedio	2,70		2,85	2,80	
Saldo	2,65		2,76	2,78	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de junio de 2018	27 059,3		27 089,3	26 229,4	
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 15 de junio de 2018	904,9	904,9	904,9	210,0	510,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1500,0	1000,0	1000,0	500,0	690,0
Plazo de vencimiento	3490,0	1500,0	2050,0	1060,0	1200,0
Tasas de Intra Miriama	1 d	7 d	1 d	1 d	1 d
Máxima	2,91	2,98	2,78	2,90	2,88
Promedio	2,91	2,98	2,93	2,96	3,11
Saldo	2,91	2,75	2,82	2,90	3,11
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 11 de junio de 2018	2 500,0	2 400,0	2 300,0	2 200,0	2 200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 11 al 15 de junio de 2018	3 350,0	2 850,0	2 450,0		
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Miriama					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el					
Vencimiento de CDLD BCRP del 11 al 15 de junio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Miriama					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 11 al 15 de junio de 2018					
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Miriama					
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 11 al 15 de junio de 2018	0,0	0,0	0,0		
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Miriama					
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 11 al 15 de junio de 2018	0,0	0,0	0,0		
vii. Compra con compromiso de Recupera de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas	200,0				
Plazo de vencimiento	530,0				
Tasas de Intra Miriama	185,4				
Máxima	3,15				
Promedio	3,30				
Saldo	3,39				
Próximo vencimiento de Repo Regular el 13 de junio de 2018	5 483,1	5 483,1	5 483,1	5 483,1	5 483,1
Vencimiento de REPO del 11 al 15 de junio de 2018	225,0	225,0	225,0		
viii. Compra con compromiso de Recupera de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas	0,0				
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Miriama					
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 11 al 15 de junio de 2018	0,0	0,0	0,0		
ix. Compra con compromiso de Recupera de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Miriama					
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 11 al 15 de junio de 2018					
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Miriama					
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 11 al 15 de junio de 2018	0,0	0,0	0,0		
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Miriama					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra					
Vencimiento de SC - Compra del 11 al 15 de junio de 2018	0,0	0,0	0,0		
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
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					
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	4 739,3	4 483,7	4 427,5	3 977,7	4 884,5
a. Compra temporal de moneda extranjera (oversh)					
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	310,0	461,0	370,0	222,4	400,0
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	4 429,3	4 622,7	4 627,5	3 755,3	4 584,5
f Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	9 142,7	9 814,1	9 700,5	9 389,9	9 389,8
g Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEI) (*)	6,8	7,0	6,8	6,8	6,8
h Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 294,8	5 092,9	4 920,3	4 601,0	4 588,9
i Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEI) (*)	3,1	3,7	3,6	3,3	3,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1 272,5	741,3	1 028,8	1 028,8	1 098,4
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	2 752,80/2,75	2 752,80/2,75	2 752,75/2,75	2 752,75/2,75	2 752,85/2,78
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	72,0	80,2	0,0	29,0	29,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	01 Junio 18	04 Junio 18	05 Junio 18	06 Junio 18	07 Junio 18
Flujo de la posición global = a + b - c - d - e + f + g	-111,8	-2,2	23,0	-100,8	237,3
Flujo de la posición contable = a + b - c - d - e + f + g	6,5	36,4	-109,1	-54,5	-54,4
a. Mercado spot con el público	-2,9	-24,8	-164,7	-80,3	-153,5
i. Compras	240,3	257,4	212,1	238,4	333,8
ii (-) Ventas	243,2	282,2	376,7	319,6	487,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-93,6	124,0	26,4	-15,8	-15,8
i. (-) Ventadas	59,9	270,4	324,7	156,6	342,6
ii (+) Ventadas	153,5	146,4	308,3	204,0	358,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	79,8	153,6	-101,9	44,6	-348,5
i. (-) Placadas	136,5	224,5	183,7	289,5	528,6
ii (+) Ventadas	56,7	69,9	285,6	244,9	877,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	784,1	510,3	823,9	637,2	1083,5
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	0,0	33,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-33,8	-20,7	33,2	70,7	575,4
i. Compras	63,2	63,2	254,3	254,3	875,3
ii (-) Ventas	90,0	83,3	250,8	173,8	299,9
f. Efecto de Operaciones	1,1	-0,4	3,9	6,4	-0,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,5	0,9	-0,4	-0,0	1,5
n. Impacto por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2717	3,2720	3,2708	3,2696	3,2608
(*) Datos preliminares					