

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	11 Junio 18	12 Junio 18	13 Junio 18	14 Junio 18	15 Junio 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 894,3	3 223,5	3 598,4	3 617,3	1 106,3
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		30,0	30,0	200,0
Plazo de vencimiento	245,0		115,0	203,0	794,0
Tasas de Inté Miráma	178,4		538,4	337,4	82,4
Máxima	2,65		2,77	2,68	2,59
Promedio	2,65		2,77	2,75	2,67
Saldo	26 274,4	26 064,4	26 109,4	26 334,4	26 334,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de julio de 2018	210,0		300,0	750,1	750,1
Vencimiento de CD BCRP del 18 al 22 de junio de 2018	510,0		300,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	800,0		800,0	1 400,0	450,0
Plazo de vencimiento	840,0		840,0	1 400,0	800,0
Tasas de Inté Miráma	1,4		1,4	1,4	3,4
Máxima	2,77		2,77	2,75	3,0
Promedio	3,04		2,97	3,04	3,2
Saldo	3 860,0	3 060,0	3 060,0	3 060,0	2 810,0
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 18 de junio de 2018	800,0		700,0	700,0	450,0
Vencimiento de REPO BCRP del 18 al 22 de junio de 2018	1 500,0		700,0		810,0
iii. Subasta de Certificado de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inté Miráma					
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
Vencimiento de CDLD BCRP del 18 al 22 de junio de 2018	0,0		0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	600,0		600,0	1 400,0	0,0
Plazo de vencimiento	1 954,6		1 954,6	1 954,6	0,0
Tasas de Inté Miráma	1,4		1,4	1,4	3,0
Máxima	2,00		2,00	2,00	165,4
Promedio	2,48		2,48	2,48	3,00
Saldo	2,28		2,28	2,28	3,50
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	600,0		600,0	1 400,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 18 al 22 de junio de 2018	600,0		600,0	1 400,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inté Miráma					
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	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 18 al 22 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 Inté Miráma					
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	510,0
Vencimiento de CDR BCRP del 18 al 22 de junio 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 Inté Miráma					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 483,1	5 483,1	5 258,1	5 258,1	5 686,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 25 de junio de 2018	225,0		400,0	400,0	300,0
Vencimiento de REPO del 18 al 22 de junio de 2018	0,0		400,0		0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inté Miráma					
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	800,0
Vencimiento de REPO Expansión del 18 al 22 de junio 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 Inté Miráma					
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	500,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 18 al 22 de junio de 2018					
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inté Miráma					
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	400,1
Vencimiento de SC - Venta del 18 al 22 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 Inté Miráma					
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
Vencimiento de SC - Compra del 18 al 22 de junio 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\$)					
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					
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	3 664,3	3 223,5	2 968,4	1 722,3	1 756,3
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	477,7	627,7	1 274,7	67,8	160,2
Tasa de interés	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%
4. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 186,6	2 598,6	1 693,6	1 654,6	1 596,1
f Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	9 241,8	9 127,8	8 926,4	9 127,8	8 747,0
f Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEI) (*)	6,7	6,8	6,6	6,6	6,3
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 668,4	4 311,9	4 110,5	4 110,5	3 942,9
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEI) (*)	3,2	3,1	3,0	3,1	2,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CD BCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 155,2	1 300,8	909,0	688,0	1 266,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,70/2,80/2,75	2,75/2,75/2,75	2,70/2,80/2,75	2,75/2,75/2,75	2,75/2,85/2,78
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	22,0	20,0	12,5	27,5	49,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	2,00/2,00/2,00	2,00/2,00/2,00
c. Total mercado secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y CDV	25,0	7,0	5,0	0,0	6,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					4,0 / 2,63
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	08 Junio 18	11 Junio 18	12 Junio 18	13 Junio 18	14 Junio 18
Flujo de la posición global = a + b - c - d + e + f + g	-63,3	-67,4	-66,4	-6,6	-137,5
Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + f + g	125,9	45,6	-96,7	-76,4	-105,3
a. Mercado spot con el público	67,2	62,7	-115,4	-41,4	-127,7
i. Compras	367,3	323,3	222,3	266,4	265,5
ii (-) Ventas	300,0	260,5	337,7	247,8	413,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	39,9	25,7	5,8	-11,7	-79,4
i. (-) Ventas	127,2	67,0	168,8	152,7	65,2
ii (-) Ventas	87,9	92,7	193,0	133,4	134,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	227,2	77,9	78,9	-82,1	-47,4
i. (-) Ventas	541,8	149,8	145,0	277,9	222,2
ii (-) Ventas	314,4	71,0	202,1	360,0	269,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	586,9	567,0	604,0	808,4	825,1
ii. A futuro	20,0	60,0	2,0	2,0	2,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	282,7	-36,9	28,5	199,0	163,8
i. Compras	361,6	361,9	264,9	264,9	264,9
ii (-) Ventas	21,9	75,0	171,8	102,8	102,8
f. Efecto de Opciones	-1,8	-1,0	-0,7	0,4	-0,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	2,4	-1,8	-2,7	-7,4	-6,2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2626	3,2659	3,2702	3,2648	3,2670
(*) Datos preliminares					