BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	23 Julio 18	24 Julio 18	25 Julio 18	26 Julio 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**-19,1**	**243,2**	**627,9**	**410,3**
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
Plazo de vencimiento	185.0		102.3	160.0
Tasas de interés Mínima	164 d		527 d	341 d
Máxima	2.47		2.62	2.51
Promedio	2.50		2.70	2.55
Saldo	2.50		2.70	2.55
Próximo vencimiento de CD BCRP el 09 de agosto de 2018	24 255.7	23 355.8	23 385.8	23 415.8
Vencimiento de CD BCRP del 25 al 27 de julio de 2018		1 300.0		1 300.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)		0.0		0.0
Propuestas recibidas	500.0 900.0	500.0 250.0 500.0	600.0 200.0	600.0 900.0
Plazo de vencimiento	1150.0 1250.0	1120.0 528.0 500.0	1120.0 300.0	1120.0 600.0
Tasas de interés Mínima	1 d 1 d	1 d 184 d 1 d	1 d 1 d	4 d 4 d
Máxima	2.89 2.79	2.87 3.26 2.81	2.85 2.86	2.88 2.76
Promedio	2.88 2.88	2.87 3.46 2.83	2.88 2.88	2.88 2.84
Saldo	2.89 2.81	2.87 3.38 2.83	2.88 2.87	2.88 2.80
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 30 de julio de 2018	5 250.0	5 100.0	4 900.0	5 600.0
Vencimiento de REPO BCRP del 25 al 27 de julio de 2018		1 000.0		1 500.0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)		1 000.0		1 500.0
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el		0.0		0.0
Vencimiento de CDLD BCRP del 25 al 27 de julio de 2018		0.0		0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el				
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 24 al 27 de julio de 2018				
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	3 300.0	2 800.0	2 400.0	2 400.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 24 de octubre de 2018		400.0		500.0
Vencimiento de Coloc-TP del 25 al 27 de julio de 2018		400.0		0.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el		0.0		0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 25 al 27 de julio de 2018		0.0		0.0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	4 308.0	4 308.0	4 308.0	4 308.0
Próximo vencimiento de Reco Regular el 24 de agosto de 2018		500.0		500.0
Vencimiento de REPO del 25 al 27 de julio de 2018		0.0		0.0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	1 250.0	1 250.0	1 250.0	1 250.0
Próximo vencimiento de Reco Expansión el 14 de Setiembre de 2018		800.0		800.0
Vencimiento de REPO Expansión del 25 al 27 de julio de 2018		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	2 300.0	2 300.0	2 300.0	2 300.0
Próximo vencimiento de Reco Sustitución el 24 de agosto de 2018		500.0		500.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 25 al 27 de julio de 2018		0.0		0.0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el		0.0		0.0
Vencimiento de SC - Venta del 25 al 27 de julio de 2018		0.0		0.0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Compra		0.0		0.0
Vencimiento de SC - Compra del 25 al 27 de julio de 2018		0.0		0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	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
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público				
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP				
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**1 350,9**	**1 493,2**	**1 397,9**	**1 880,3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Comisión tasa efectiva diaria	0.0077%	0.0077%	0.0077%	0.0088%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	45.7	354.5	170.0	641.0
Tasa de interés	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 305,2**	**1 138,7**	**1 227,9**	**1 239,2**
i. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	7 593.0	7 652.8	7 447.7	7 364.8
ii. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.4	5.5	5.3	5.3
iii. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 855.3	2 783.8	2 574.3	2 523.0
iv. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.9	2.0	1.8	1.8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 618.0	930.0	505.5	1 184.0
Tasas de interés Mínima / Máxima / Promedio	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	8.0
Tasas de interés Mínima / Máxima/ Promedio				2.00/2.00/2.00
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	43.0	0.0	20.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	10.0 / 2.55			
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**20 Julio 18**	**23 Julio 18**	**24 Julio 18**	**25 Julio 18**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-35.7	16.3	-73.4	-17.8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	11.7	101.4	-210.0	4.5
a. Mercado spot con el público	36.7	85.7	-190.5	-19.9
i. Compras	261.9	291.9	210.7	225.4
ii. (-) Ventas	225.2	206.3	401.2	245.3
b. Compras forward al publico (con y sin entrega)	50.6	72.2	41.0	-42.6
i. Pactadas	154.2	197.9	210.5	192.5
ii. (-) Vencidas	103.6	125.7	169.5	235.1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	97.8	153.2	-94.9	-17.2
i. Pactadas	158.2	317.1	135.7	88.5
ii. (-) Vencidas	60.4	163.9	230.6	105.7
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. al contado	647.0	464.8	584.0	589.0
ii. a futuro	43.0	94.6	91.0	30.0
e. Operaciones sont asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entreoa	-55.4	57.1	45.1	-104.3
i. Compras	31.6	158.0	196.3	100.5
ii. (-) Ventas	87.0	100.9	151.2	204.8
f. Efecto de Opciones	-0.1	-4.1	0.6	3.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-12.8	-3.3	-3.5	-0.7
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.2741	3.2804	3.2731	3.2731

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera