BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	15 Octubre 18	16 Octubre 18	17 Octubre 18	18 Octubre 18	19 Octubre 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**4 821,1**	**5 010,0**	**3 522,4**	**3 108,3**	**1 501,3**
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)	50.0	500.0	50.0 500.0	50.0 300.0	
Propuestas recibidas	237.5	2151.0	167.0 1803.0	197.5 1193.0	
Plazo de vencimiento	169 d	86 d	533 d 85 d	349 d 82 d	
Tasas de inte Mínima	2.60	2.50	2.95 2.50	2.78 2.50	
Máxima	2.62	2.50	2.99 2.50	2.85 2.52	
Promedio	2.61	2.50	2.99 2.50	2.82 2.50	
Saldo	25 129.6	25 629.6	26 179.6	26 249.6	26 249.6
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de setiembre de 2018	295.0		295.0		30.0
Vencimiento de CD BCRP del 22 al 26 de octubre de 2018	295.0		295.0		30.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					400.0
Propuestas recibidas					400.0
Plazo de vencimiento					3 d
Tasas de inte Mínima					2.85
Máxima					2.85
Promedio					2.85
Saldo	4 700.0	4 700.0	4 700.0	4 700.0	5 100.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de diciembre de 2018	300.0		300.0		400.0
Vencimiento de REPO BCRP del 22 al 26 de octubre de 2018	0.0		0.0		400.0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
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
Vencimiento de CDLD BCRP del 22 al 26 de octubre de 2018	0.0		0.0		0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	1000.0 600.0	1000.0 500.0	500.0	500.0	
Propuestas recibidas	2694.0 2155.5	2368.3 1211.6	1944.2	2706.2	
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d	1 d	
Tasas de inte Mínima	2.25 2.06	2.29 2.0	2.0	2.0	
Máxima	2.40 2.33	2.39 2.30	2.15	2.02	
Promedio	2.34 2.26	2.35 2.21	2.10	2.01	
Saldo	1 600.0	1 500.0	500.0	500.0	0.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de agosto de 2018	1 600.0		500.0		0.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 22 al 26 de octubre de 2018	1 600.0		500.0		0.0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 300.0	3 300.0	3 300.0	3 300.0	3 300.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 24 de octubre de 2018	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de Coloc-TP del 22 al 26 de octubre de 2018	0.0		0.0		500.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 22 al 26 de octubre 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 inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 908.0	4 908.0	4 908.0	4 908.0	4 908.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 24 de agosto de 2018	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de REPO del 22 al 26 de octubre 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 inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	150.0	150.0	150.0	150.0	150.0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 14 de Setiembre de 2018	150,0		150,0		150,0
Vencimiento de REPO Expansión del 22 al 26 de octubre 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 inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 800.0	1 800.0	1 800.0	1 800.0	1 800.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 24 de agosto de 2018	200,0		200,0		200,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 22 al 26 de octubre de 2018	0.0		0.0		0.0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	500,0 85.0			300,0	
Propuestas recibidas	820.0 115.0			775.0	
Plazo de vencimiento	60 d 60 d			61 d	
Tasas de inte Mínima	1,35 1,90			1,60	
Máxima	1.75 2.00			1.85	
Promedio	1.54 1.98			1.75	
Saldo	1 985.0	1 985.0	1 985.0	2 285.0	2 285.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 15 octubre de 2018	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de SC - Venta del 22 al 26 de octubre de 2018	0,0		0,0		0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
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 22 al 26 de octubre 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$)	2.60	5.30		20.70	0.80
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público	2.6				
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3 171.1**	**3 010.0**	**2 472.4**	**2 258.3**	**1 901.3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0105%	0.0106%	0.0105%	0.0105%	0.0086%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	30.5	64.9	322.8	582.5	557.0
Tasa de interés	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3 140,6**	**2 945,1**	**2 149,7**	**1 675,8**	**1 344,3**
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8 510.9	8 478.3	8 448.7	8 303.6	8 217.7
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.9	5.9	5.9	5.8	5.7
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 505.6	3 472.3	3 441.3	3 299.0	3 213.6
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.4	2.4	2.4	2.3	2.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	890.1	1 070.0	1 178.9	956.5	1 106.6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2.75/2.75/2.75	2.50/2.75/2.71	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.70/2.85/2.76
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	54.0	29.0	61.0	47.0	47.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	2.25/2.25/2.25	2.25/2.25/2.25	2.25/2.25/2.25	2.25/2.25/2.25	2.25/2.25/2.25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					

7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	12 Octubre 18	15 Octubre 18	16 Octubre 18	17 Octubre 18	18 Octubre 18
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-71.3	-93.1	46.0	-174.0	217.6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-29.5	-52.1	-7.4	-154.3	-37.6
a. Mercado spot con el público	-56.2	-54.2	-12.3	-158.7	-29.8
i. Compras	231.5	203.7	241.2	196.2	394.4
ii (-) Ventas	287.7	257.9	253.5	354.9	424.2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	112.3	35.6	58.8	73.0	104.2
i. Pactadas	258.9	175.8	160.8	192.1	278.1
ii (-) Vencidas	146.6	140.2	102.0	119.1	173.9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	153.5	10.4	5.8	88.6	-63.7
i. Pactadas	345.4	328.5	191.0	286.4	493.0
ii (-) Vencidas	191.8	318.0	185.2	197.9	556.8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	809.0	874.2	838.3	684.7	833.9
ii. A futuro	43.0	133.0	115.0	30.0	10.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	78.7	184.6	87.5	86.4	382.0
i. Compras	191.3	314.6	171.1	197.2	551.1
ii (-) Ventas	112.6	130.1	83.6	110.7	169.0
f. Efecto de Opciones	-0.6	-0.5	0.4	-4.1	-2.7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-6.8	-70.3	0.6	-3.2	83.0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3327	3,3370	3,3325	3,3349	3,3373
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera