

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	07 Mayo 18	08 Mayo 18	09 Mayo 18	10 Mayo 18	11 Mayo 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 320,6	3 730,8	3 898,4	4 616,3	3 273,2
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias arrojadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	50,0		50,0	50,0	
Propuestas recibidas	316,5		152,3	201,9	
Plazo de vencimiento	195 d		547 d	864 d	
Tasas de Inter	2,5		2,6	2,6	
Mínima	2,5		2,7	2,7	
Máxima	2,6		2,7	2,6	
Promedio	2,6		2,7	2,6	
Saldo	27 691,5	26 665,4	26 740,4	26 085,4	26 085,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de mayo de 2018	1 026,1		730,0		506,0
Vencimiento de CD BCRP del 14 al 18 de mayo de 2018	1 756,1		730,0		506,0
ii. Subasta de Comora Temoooral de Valores (REPO)	300,0	1200,0			
Propuestas recibidas	840,0	1320,0			
Plazo de vencimiento	92 d	1 d			
Tasas de Inter	2,95	2,75			
Mínima	3,03	2,77			
Máxima	3,00	2,75			
Promedio	3,00	2,75			
Saldo	4 408,9	3 209,9	3 209,9	3 209,9	2 809,9
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 04 de junio de 2018	1 200,0		400,0		300,0
Vencimiento de REPO BCRP del 14 al 18 de mayo de 2018	1 600,0		400,0		0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter					
Mínima					
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 14 al 18 de mayo de 2018	0,0		0,0		0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas				1 000,0	500,0
Plazo de vencimiento				1 935,0	1 938,0
Tasas de Inter				1 d	3 d
Mínima				2,0	2,1
Máxima				2,7	2,4
Promedio				2,2	2,2
Saldo				1 000,0	500,1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 14 de mayo de 2018					500,1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 14 al 18 de mayo de 2018					500,1
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter					
Mínima					
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 14 al 18 de mayo de 2018	0,0		0,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			200,0	310,0	
Propuestas recibidas			560,0	500,0	
Plazo de vencimiento			61 d	61 d	
Tasas de Inter			1,49	1,60	
Mínima			1,60	1,70	
Máxima			1,53	1,69	
Promedio			1,53	1,69	
Saldo	0,0	0,0	510,0	510,0	510,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 09 de julio de 2018	0,0		510,0		510,0
Vencimiento de CDR BCRP del 14 al 18 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					
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 14 al 18 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					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 850,0	1 850,0	1 850,0	1 850,0	1 250,0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 14 de Setiembre de 2018	600,0		600,0		800,0
Vencimiento de REPO Expansión del 14 al 18 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					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 980,0	2 980,0	2 980,0	2 980,0	2 580,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 18 de mayo de 2018	400,0		400,0		280,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 14 al 18 de mayo de 2018	400,0		400,0		280,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		400,0	60,0		
Propuestas recibidas		887,0	250,0		
Plazo de vencimiento		59 d	59 d		
Tasas de Inter		1,14	1,70		
Mínima		1,64	1,75		
Máxima		1,45	1,74		
Promedio		1,45	1,74		
Saldo	400,1	860,1	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 14 al 18 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					
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 14 al 18 de mayo 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			2,73		
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	3 770,6	3 730,8	3 338,4	3 566,3	2 773,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0077%
Comisión (tasa efectiva diaria)					
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 requisição monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	5,0	75,0	140,0	18,2	177,4
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	3 765,6	3 655,8	3 198,4	3 548,1	2 595,8
i. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 229,8	8 391,6	8 369,3	8 409,8	8 269,7
ii. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	6,0	6,1	6,1	6,1	6,0
iii. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 284,4	3 399,7	3 377,3	3 377,3	3 306,3
iv. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	2,4	2,5	2,4	2,5	2,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	680,5	877,0	1 060,3	1 402,0	918,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,75/2,75/2,75	2,75/2,80/2,75	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\$)	417,0	452,0	271,0	298,0	225,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	20,0	22,5	104,0	40,0	57,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	20,0 / 2,57				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	04 Mayo 18	07 Mayo 18	08 Mayo 18	09 Mayo 18	10 Mayo 18
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	36,2	80,9	19,9	-89,1	178,8
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	21,3	5,5	47,3	-53,3	49,7
a. Mercado spot con el público	29,7	141,6	39,7	-21,6	45,0
i. Compras	256,5	341,3	367,4	307,9	390,9
ii (-) Ventas	226,7	199,9	327,7	524,0	345,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	150,1	-72,9	-45,4	99,2	210,9
i. Pacifadas	267,3	129,1	97,0	205,1	434,3
ii (-) Vencidas	117,2	202,0	142,4	105,9	223,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	135,0	-152,9	119,4	254,7	87,9
i. Pacifadas	217,6	148,4	470,1	418,1	277,6
ii (-) Vencidas	82,6	301,3	350,7	155,4	189,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	995,2	531,0	645,9	674,1	923,6
ii. A futuro	3,0	0,0	5,0	3,0	20,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-22,1	-22,2	218,0	44,0	-26,8
i. Compras	53,9	178,4	344,1	140,0	183,0
ii (-) Ventas	76,0	196,6	124,2	96,0	211,9
f. Efecto de Opciones	0,0	-4,6	-2,4	-1,8	6,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-21,2	-18,5	135,8	289,9	-0,2
h. Crédito por requisição monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2709	3,2788	3,2890	3,2929	3,2729
*1) Datos preliminares					