

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	02 Julio 18	03 Julio 18	04 Julio 18	05 Julio 18	06 Julio 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	-323,2	977,3	2 055,0	1 938,7	2 445,0
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	30,0
Plazo de vencimiento	236,0		135,0	133,0	133,0
Tasas de Intra Mínima	195,4		549,4	362,4	362,4
Máxima	2,59		2,70	2,60	2,60
Promedio	2,61		2,70	2,70	2,70
Saldo	26 604,3	26 604,3	26 604,3	26 604,3	26 604,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de julio de 2018	750,1	750,1	750,1	750,1	750,1
Vencimiento de CD BCRP del 09 al 13 de julio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	2500,0	2000,0	300,0	1200,0	1000,0
Plazo de vencimiento	5000,0	500,0	1580,0	1179,0	2000,0
Tasas de Intra Mínima	1 d 185,4	1 d 184,4	7 d 184,4	7 d 184,4	7 d 184,4
Máxima	2,84	3,42	2,83	2,75	2,77
Promedio	3,15	3,44	3,00	2,91	2,88
Saldo	8 600,0	8 150,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 09 de julio de 2018	4 000,0	2 750,0	2 400,0	2 100,1	2 750,0
Vencimiento de REPO BCRP del 09 al 13 de julio de 2018	4 700,0	2 950,0	2 400,0	2 100,1	4 050,0
ii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el					
Vencimiento de CDLD BCRP del 09 al 13 de julio de 2018					
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 09 al 13 de julio de 2018					
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra 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 julio de 2018	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 09 al 13 de julio de 2018	0,0	0,0	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 Mínima					
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	510,0
Vencimiento de CDR BCRP del 09 al 13 de julio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 508,0	4 508,0	4 508,0	4 508,0	4 508,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 11 de julio de 2018	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO del 09 al 13 de julio de 2018					
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0
Próximo vencimiento de Repo Exansión el 14 de Setiembre de 2018	800,0	800,0	800,0	800,0	800,0
Vencimiento de REPO Exansión del 09 al 13 de julio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Mínima					
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	500,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 09 al 13 de julio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 260,1	860,0	860,0	860,0	400,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 09 julio 2018	400,1	460,0	460,0	460,0	400,0
Vencimiento de SC - Venta del 09 al 13 de julio de 2018	860,1	400,0	400,0	400,0	400,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Intra Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra					
Vencimiento de SC - Compra del 09 al 13 de julio de 2018					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
i. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público		4,9	4,9	4,9	4,9
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	4 348,8	4 527,3	4 525,0	4 398,8	4 345,0
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%	0,0087%	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	24,3	34,4	21,4	25,0	130,0
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	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	4 322,5	4 492,9	4 493,7	4 253,8	4 215,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	7 301,1	8 038,9	8 851,7	8 241,2	8 476,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,7	6,1	5,7	5,9	6,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 525,0	3 269,8	3 620,4	3 402,0	3 629,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	2,5	2,2	2,5	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	865,6	978,8	909,0	1 007,0	1 071,0
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	2,75/2,75/2,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	25,0	65,5	127,5	140,0	115,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,00/2,00/2,00	2,00/2,00/2,00	2,00/2,00/2,00	2,00/2,00/2,00	2,00/2,00/2,00
c. Total mercado secundario de CDBCRP - CDBCRP-NR y CDV/	84,0	84,0	84,0	84,0	84,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 Junio 18	02 Julio 18	03 Julio 18	04 Julio 18	05 Julio 18
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	-0,3	-51,0	-108,5	82,5	58,2
Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + g	73,4	210,9	410,9	101,5	87,8
a. Mercado spot con el público	0,1	120,7	17,1	65,9	83,7
i. Compras	491,9	383,1	230,4	283,5	291,5
ii. (-) Ventas	491,9	272,4	213,3	177,5	207,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	74,1	-22,2	47,6	24,6	-100,3
i. Compras	192,8	259,6	257,6	57,4	115,9
ii. (-) Ventas	95,7	273,1	180,0	32,8	516,2
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	147,6	77,8	77,8	41,6	-70,9
i. Compras	216,9	436,8	172,0	47,3	287,3
ii. (-) Ventas	69,3	307,6	94,2	5,8	358,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	499,2	626,3	565,5	485,5	705,5
ii. A futuro	40,0	60,0	60,0	45	45
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	50,1	118,5	-54,9	5,2	-149,9
i. Compras	65,4	67,8	62,7	62,7	62,7
ii. (-) Ventas	15,2	160,2	123,6	0,5	471,4
f. Efecto de Opciones	-0,2	-8,5	-1,5	-1,0	-0,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-3,3	-3,3	-15,8	2,4	-4,0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalect)	3,2727	3,2884	3,2860	3,2910	3,2900
(*) Datos preliminares					