BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	20 Mayo 19	21 Mayo 19	22 Mayo 19	23 Mayo 19	24 Mayo 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**3 031,9**	**2 069,0**	**1 876,5**	**1 898,3**	**776,2**
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		50.0	50.0	
Propuestas recibidas	187.0		170.0	129.0	
Plazo de vencimiento	176 d		531 d	350 d	
Tasas de inte Mínima	2.56		2.76	2.68	
Máxima	2.57		2.78	2.69	
Promedio	2.56		2.77	2.68	
Saldo	27 131.8	27 131.8	27 206.8	27 281.8	27 281.8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 6 de junio de 2019	1 585.0		1 585.0		1 585.0
Vencimiento de CD BCRP del 27 al 31 de mayo de 2019	0.0		0.0		0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				300.0	200.0
Propuestas recibidas				515.0	700.0
Plazo de vencimiento				186 d	3 d
Tasas de inte Mínima				3.52	3.20
Máxima				3.58	3.20
Promedio				3.54	3.20
Saldo	5 750.0	5 750.0	5 750.0	5 750.0	5 950.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 27 de mayo de 2019.	200.0		300.0		200.0
Vencimiento de REPO BCRP del 27 al 31 de mayo de 2019	500.0		300.0		200.0
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	0.0	0.0
Vencimiento de CDLD BCRP del 27 al 31 de mayo de 2019	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	1400.0	1118.0	649.8		
Propuestas recibidas	1477.0	1118.0	1093.5		
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d		
Tasas de inte Mínima	2.54	2.59	2.50		
Máxima	2.74	2.75	2.66		
Promedio	2.67	2.67	2.60		
Saldo	1 400.0	1 118.0	649.8	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Depósitos	1 400.0		649.8		0.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 27 al 31 de mayo de 2019	1 400.0		649.8		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	4 400.0	4 400.0	4 400.0	4 400.0	4 400.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de junio de 2019	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 27 al 31 de mayo de 2019	0.0		0.0		0.0
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	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 27 al 31 de mayo de 2019	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	10 953.1	10 953.1	10 953.1	10 953.1	10 953.1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 03 de junio de 2019	400.0		400.0		400.0
Vencimiento de REPO del 27 al 31 de mayo de 2019	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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Expansion	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de REPO Expansión del 27 al 31 de mayo de 2019	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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 27 al 31 de mayo de 2019	0.0		0.0		0.0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		300.0			
Propuestas recibidas		545.0			
Plazo de vencimiento		62 d			
Tasas de inte Mínima		0.93			
Máxima		1.70			
Promedio		1.26			
Saldo	0.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 22 de julio 2019			300.0		300.0
Vencimiento de SC - Venta del 27 al 31 de mayo de 2019	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 27 al 31 de mayo de 2019	0.0		0.0		0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	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$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**1 581.9**	**1 151.0**	**1 176.7**	**1 198.5**	**976.2**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0105%	0.0105%	0.0105%	0.0105%	0.0095%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	435.0	106.1		340.0	
Tasa de interés	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 146,9**	**1 044,9**	**1 176,7**	**858,5**	**976,2**
Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9 998.2	10 131.3	9 998.2	10 131.3	9 998.2
Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.6	6.6	6.6	6.6	6.6
Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 533.9	4 668.5	4 533.9	4 668.5	4 533.9
Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.0	3.1	3.0	3.1	3.0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	912.7	638.5	799.7	734.7	763.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2.40/2.75/2.74	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.75/2.80/2.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio					
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$)	**17 Mayo 19**	**20 Mayo 19**	**21 Mayo 19**	**22 Mayo 19**	**23 Mayo 19**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-62.1	-21.5	-5.6	-29.7	138.9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	48.3	177.2	31.2	-71.8	83.0
a. Mercado spot con el público	10.2	190.3	15.6	-74.9	52.1
i. Compras	330.0	447.5	347.8	312.0	475.9
ii. (-) Ventas	319.8	257.2	332.2	386.9	423.8
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	78.3	-44.0	138.8	96.8	2.4
i. Pactadas	116.6	227.2	181.1	169.4	328.7
ii. (-) Vencidas	38.3	271.2	42.3	72.6	326.3
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	187.7	150.5	263.8	59.9	-53.0
i. Pactadas	200.5	443.2	455.0	273.8	485.3
ii. (-) Vencidas	12.9	292.7	191.2	213.8	538.3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	449.4	627.1	667.1	800.0	665.0
ii. A futuro	7.0	124.0	23.0	27.0	48.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	0.8	9.9	158.8	151.1	245.7
i. Compras	8.3	228.7	186.9	213.3	528.7
ii. (-) Ventas	7.5	218.8	28.1	62.2	283.0
f. Efecto de Opciones	-1.1	-4.3	-1.5	5.2	0.6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	11.8	-1.3	95.3	-6.7	-2.8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3242	3,3394	3,3459	3,3455	3,3495
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera