

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	27 Mayo 19	28 Mayo 19	29 Mayo 19	30 Mayo 19	31 Mayo 19
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>1 314,5</b>	<b>1 339,2</b>	<b>2 069,3</b>	<b>2 027,3</b>	<b>1 928,7</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	50,1		50,0	50,0	
Plazo de vencimiento	169,3		252,0	252,0	
Tasas de interés	189,4		524,4	371,4	
Mínima	2,52		2,72	2,64	
Máxima	2,60		2,78	2,87	
Promedio	2,57		2,74	2,65	
Saldo	27 381,9	27 381,9	27 453,9	27 533,9	27 503,9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 6 de junio de 2019	1 585,0	1 585,0	1 585,0	1 585,0	1 585,0
Vencimiento de CD BCRP del 3 al 7 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporales de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 750,0	5 750,0	5 750,0	5 750,0	5 750,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 17 de junio de 2019	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 3 al 7 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 31 de mayo de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 3 al 7 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 31 de mayo de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 3 al 7 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
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	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc TP del 3 al 7 de junio de 2019	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 interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 31 de mayo de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 3 al 7 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Resuan)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
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	400,0	400,0
Vencimiento de REPO del 3 al 7 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 31 de mayo de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Expansión del 3 al 7 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 31 de mayo de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 3 al 7 de junio de 2019	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 interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 22 de julio de 2019	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de SC - Venta del 3 al 7 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	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	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra el 31 de mayo de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 3 al 7 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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					
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					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>1 264,5</b>	<b>1 339,2</b>	<b>1 019,3</b>	<b>97,3</b>	<b>876,7</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva anual)	0,0105%	0,0105%	0,0105%	0,0105%	0,0094%
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 revaluación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	86,1	300,0	162,0	94,0	20,0
d. Depósitos Overmight en moneda nacional					
Tasa de interés	1,20%	1,20%	1,20%	1,20%	1,20%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>1 178,4</b>	<b>1 239,2</b>	<b>857,9</b>	<b>883,3</b>	<b>858,7</b>
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	7 572,8	7 533,5	7 893,5	7 825,5	7 731,1
g. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,2	5,2	5,2	5,1	5,1
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 518,8	2 478,2	2 437,5	2 377,1	2 324,9
i. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,6	1,6	1,6	1,5
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la venta en moneda nacional	984,0	1 146,0	390,7	626,8	1 023,1
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2 752,752,75	2 752,752,75	2 752,752,75	2 752,752,75	2 752,752,75
b. Operaciones a la venta en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>24 Mayo 19</b>	<b>27 Mayo 19</b>	<b>28 Mayo 19</b>	<b>29 Mayo 19</b>	<b>30 Mayo 19</b>
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	-102,2	99,3	149,9	23,7	23,7
Flujo de la posición comercial = a + b - c + e + f + g	-96,1	96,3	149,9	74,8	201,4
a. Mercado spot con el público	-129,9	-47,8	81,7	-187,8	-187,8
i. Compras	294,8	226,6	412,1	375,6	375,6
ii (-) Ventas	330,4	275,9	330,4	561,3	561,3
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	135,3	90,7	172,2	91,5	91,5
i. (-) Ventas	278,4	168,9	287,9	401,6	401,6
ii (+) Compras	142,9	98,1	115,3	212,7	212,7
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	141,0	128,0	173,7	-132,4	-132,4
i. (-) Ventas	362,2	312,0	318,6	355,4	355,4
ii (+) Compras	224,2	184,1	144,3	487,8	487,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	446,0	430,2	680,0	640,0	674,6
ii. A futuro	169,0	30,0	70,0	14,0	14,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	99,3	-30,3	38,9	242,2	161,8
f. Compras	197,9	2,6	109,7	458,6	458,6
ii (-) Ventas	98,7	33,3	70,9	176,8	290,2
g. Efectos de Opciones					
i. (+) Ventas					
ii. (-) Compras					
h. Operaciones netas con otras instituciones financieras	11,8	11,2	6,3	-3,2	0,3
i. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Databank)	3,3437	3,3479	3,3551	3,3571	3,3628
(*) Datos preliminares					