

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

| | 25 Abril 16 | 26 Abril 16 | 27 Abril 16 | 28 Abril 16 | 29 Abril 16 |
|--|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP | 754,2 | 1 477,7 | 1 866,3 | 2 340,7 | 2 048,5 |
| 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 | 151,0 | | 30,0 | 30,0 | |
| Plazo de vencimiento | 30,0 | | 85,0 | 121,0 | |
| Tasas de Inter Mínima | 171 d | | 533 d | 343 d | |
| Máxima | 4,45 | | 4,70 | 4,75 | |
| Promedio | 4,50 | | 4,70 | 4,85 | |
| Saldo | 4,48 | | 4,70 | 4,79 | |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Mayo de 2016 | 17 025,2 | 17 025,2 | 17 055,2 | 17 085,2 | 17 085,2 |
| Vencimiento de CD BCRP entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016 | | | | | 612,0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | 200 | 450 | 300,0 | 200,0 | 200,0 |
| Propuestas recibidas | 475 | 1518 | 425 | 785,0 | 785,0 |
| Plazo de vencimiento | 1 d | 1 d | 1 d | 7 d | 7 d |
| Tasas de Inter Mínima | 4,60 | 4,86 | 5,02 | 5,12 | 5,30 |
| Máxima | 4,66 | 4,86 | 5,03 | 5,12 | 5,30 |
| Promedio | 4,61 | 4,86 | 5,03 | 5,12 | 5,30 |
| Saldo | 1 150,0 | 856,0 | 800,0 | 1 000,0 | 1 200,0 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 4 de mayo de 2016 | | | | | 300,0 |
| Vencimiento de REPO BCRP entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016 | | | | | 700,0 |
| iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 1 600,0 | 1 600,0 | 1 600,0 | 1 600,0 | 1 600,0 |
| Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 26 de Mayo de 2016 | | | | | 400,0 |
| Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016 | | | | | 0,0 |
| iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 160,0 | 160,0 | 160,0 | 160,0 | 160,0 |
| Próximo vencimiento de CDV BCRP el 20 mayo de 2016 | | | | | 160,0 |
| Vencimientos de CDV BCRP entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016 | | | | | 0,0 |
| v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 2 500,0 | 2 500,0 | 2 500,0 | 2 500,0 | 2 500,0 |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 13 Mayo de 2016 | | | | | 300,0 |
| Vencimiento de Coloc-TP entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016 | | | | | 0,0 |
| vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 600,0 | 600,0 | 600,0 | 600,0 | 600,0 |
| Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016 | | | | | 300,0 |
| Vencimiento de Coloc - BN entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016 | | | | | 0,0 |
| vii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | 33,0 | 91,0 | | |
| Plazo de vencimiento | | 33,0 | 91,0 | | |
| Tasas de Inter Mínima | | 91 d | 91 d | | |
| Máxima | | 0,75 | 0,75 | | |
| Promedio | | 0,75 | 0,75 | | |
| Saldo | 5 716,0 | 5 449,0 | 5 385,0 | 5 385,0 | 5 085,0 |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP el 3 de Mayo de 2016 | | | | | 285,0 |
| Vencimiento de CDR BCRP entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016 | | | | | 285,0 |
| ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular) | 200,0 | | | | |
| Propuestas recibidas | 300,0 | | | | |
| Plazo de vencimiento | 732 d | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | 5,06 | | | | |
| Máxima | 5,17 | | | | |
| Promedio | 5,12 | | | | |
| Saldo | 16 000,0 | 16 000,0 | 16 000,0 | 16 000,0 | 16 000,0 |
| Próximo vencimiento de Repo Regular el 2 de Mayo de 2016 | | | | | 300,0 |
| Vencimiento de REPO entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016 | | | | | 0,0 |
| x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 7 900,0 | 7 900,0 | 7 900,0 | 7 900,0 | 7 900,0 |
| Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017 | | | | | 300,0 |
| Vencimiento de REPO Expansión entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016 | | | | | 0,0 |
| xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 4 804,7 | 4 804,7 | 4 804,7 | 4 804,7 | 4 804,7 |
| Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017 | | | | | 243,0 |
| Vencimiento de REPO Sustitución entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016 | | | | | 0,0 |
| xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | 420,0 | 865,0 | 815,0 | 570,0 | 425,0 |
| Propuestas recibidas | 610,0 | 1 705,0 | 1 354,0 | 910,0 | 950,0 |
| Plazo de vencimiento | 91 d | 91 d | 91 d | 91 d | 91 d |
| Tasas de Inter Mínima | 0,41 | 0,40 | 0,50 | 0,45 | 0,45 |
| Máxima | 0,75 | 0,73 | 0,61 | 0,75 | 0,55 |
| Promedio | 0,56 | 0,57 | 0,55 | 0,49 | 0,49 |
| Saldo | 19 697,7 | 19 557,7 | 19 558,7 | 19 180,1 | 19 182,1 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 2 de Mayo de 2016 | | | | | 480,0 |
| Vencimiento de SC - Venta entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016 | | | | | 1 127,0 |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | | | | | |
| i. Compras (millones de US\$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| ii. Tipo de cambio promedio | | | | | |
| iii. Ventas (millones de US\$) | | | | | |
| iv. 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 v BTP | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| i. Compras de CD BCRP v 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 | 1 574,2 | 1 799,7 | 2 045,3 | 2 510,7 | 2 248,5 |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps) | | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0138% | 0,0138% | 0,0137% | 0,0138% | 0,0128% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | 260,0 | | 290,0 | | |
| Tasa de interés | 4,80% | | 4,80% | | 4,80% |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | | |
| Tasa de interés | 4,80% | 4,80% | 4,80% | 4,80% | 4,80% |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 1 057,6 | 1 026,9 | 1 847,1 | 820,0 | 968,5 |
| Tasa de interés | 3,00% | 3,00% | 3,00% | 3,00% | 3,00% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 776,6 | 770,8 | 488,2 | 1 690,7 | 1 280,0 |
| i. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 4 295,8 | 4 295,8 | 4 295,8 | 4 295,8 | 4 295,8 |
| ii. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) | 7,1 | 7,2 | 7,0 | 7,0 | 6,9 |
| iii. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 2 324,3 | 2 185,3 | 2 111,6 | 2 051,5 | 2 024,9 |
| iv. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) | 2,2 | 2,0 | 2,0 | 2,0 | 2,0 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 1 162,0 | 1 098,0 | 772,0 | 737,0 | 667,0 |
| Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,30 / 4,85 / 4,62 | 4,75 / 5,05 / 4,91 | 4,75 / 5,05 / 4,96 | 4,25 / 5,05 / 4,62 | 4,45 / 5,05 / 4,64 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 109,0 | 9,0 | 9,0 | 19,0 | 13,0 |
| Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio | 0,38 / 0,38 / 0,38 | 0,38 / 0,38 / 0,38 | 0,38 / 0,38 / 0,38 | 0,30 / 0,38 / 0,34 | 0,38 / 0,45 / 0,39 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR v CDV | 69,0 | 24,0 | 65,0 | 30,0 | 10,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | 23 / 4,60 | 23 / 4,60 | | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| Plazo 18 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 22 abril 16 | 25 abril 16 | 26 abril 16 | 27 abril 16 | 28 abril 16 |
| Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g | -74,7 | -21,1 | -196,2 | 56,1 | -133,7 |
| Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g | 4,0 | -8,2 | -311,8 | -60,9 | -14,5 |
| a. Mercado spot con el público | -36,6 | -18,6 | -112,6 | -47,6 | 22,7 |
| i. Compras | 233,6 | 161,1 | 309,2 | 235,2 | 325,3 |
| ii. (-) Ventas | 272,3 | 179,7 | 421,8 | 282,7 | 302,7 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | 28,3 | -28,3 | -28,3 | 26,1 | -15,8 |
| i. Pactadas | 196,7 | 26,0 | 17,8 | 175,3 | 144,1 |
| ii. (-) Ventas | 168,4 | 53,4 | 226,5 | 149,2 | 159,8 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 92,4 | -85,6 | -85,6 | -78,8 | -9,1 |
| i. Pactadas | 207,1 | 74,9 | 138,1 | 143,9 | 119,8 |
| ii. (-) Ventas | 144,7 | 160,4 | 459,4 | 222,7 | 119,9 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 1082,7 | 614,3 | 960,6 | 431,1 | 665,4 |
| ii. A futuro | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 57,9 | 117,7 | 120,8 | 78,9 | -8,4 |
| f. Compras | 143,5 | 341,3 | 341,3 | 220,4 | 83,0 |
| g. (-) Ventas | 85,6 | 40,9 | 220,4 | 143,5 | 152,4 |
| h. Efecto de Opciones | 10,1 | 9,6 | 0,0 | 0,0 | -0,7 |
| a. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -93,7 | -60,9 | -115,0 | -4,7 | -110,5 |
| b. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datasec) | 3,2708 | 3,2843 | 3,2836 | 3,2909 | 3,2776 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |