

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	17 Abril 17	18 Abril 17	19 Abril 17	20 Abril 17	21 Abril 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	5 032.2	5 188.2	4 575.8	3 959.3	2 452.9
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	30.0 150.0 150.0	150.0 150.0 150.0	0.0 200.0 200.0 200.0	30.0 150.0 150.0 100.0	150.0
Plazo de vencimiento	205.0 458.0 477.0	364.0 407.0 513.0	40.0 432.0 475.0 678.0	140.0 432.0 475.0 678.0	395.4
Tasas de Inter Mínima	185 d 360 d 542 d	184 d 359 d 541 d	40 d 183 d 358 d 540 d	167 d 329 d 332 d 426 d	363 d 426 d
Máxima	4.14 4.23 4.30	4.14 4.18 4.25	4.25 4.13 4.17 4.22	4.12 4.16 4.20 4.24	4.14
Promedio	4.14 4.21 4.30	4.14 4.18 4.28	4.25 4.13 4.17 4.24	4.16 4.13 4.16 4.22	4.14
Saldo	28 336.9	26 486.9	27 116.9	27 546.9	27 686.9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 24 de abril de 2017	300.0		99.9		99.9
Vencimiento de CD BCRP del 24 al 28 de abril de 2017	0.0		0.0		0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 499.0	1 499.0	1 499.0	1 499.0	1 499.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 8 de mayo de 2017	399.0		399.0		399.0
Vencimiento de REPO BCRP del 24 al 28 de abril de 2017	0.0		0.0		0.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
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 Repo Especial - CDR	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 24 al 28 de abril de 2017	0.0		0.0		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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el	0.0		0.0		0.0
Vencimientos de CDV BCRP del 24 al 28 de abril de 2017	0.0		0.0		0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	2 000.0	2 000.0	2 200.1	2 000.0	1 300.1
Plazo de vencimiento	2 836.5	2 836.5	2 289.0	2 289.0	2 122.2
Tasas de Inter Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	3.60	3.60	3.67	3.67	3.60
Promedio	4.20	4.20	3.90	3.90	3.85
Saldo	3.91	3.91	3.76	3.77	3.69
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 24 de abril de 2017	2 000.0	2 700.0	2 200.1	2 000.0	1 300.1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 24 al 28 de abril de 2017	2 000.0		2 200.1		1 300.1
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
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 Coloc-TP el 08 de junio de 2017	300.1		300.1		300.1
Vencimiento de Coloc-TP del 24 al 28 de abril de 2017	0.0		0.0		0.0
vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
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 Coloc-BN el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de Coloc - BN del 24 al 28 de abril de 2017	0.0		0.0		0.0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reaustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	150.0	150.0	150.0	150.0	150.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 03 de mayo de 2017	150.0		150.0		150.0
Vencimiento de CDR BCRP del 24 al 28 de abril de 2017	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	13 980.1	13 980.1	13 980.1	13 980.1	13 980.1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 16 de Junio de 2017	400.0		400.0		400.0
Vencimiento de REPO del 24 al 28 de abril de 2017	0.0		0.0		0.0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 350.0	6 350.0	6 350.0	6 350.0	6 350.0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 02 de junio de 2017	400.0		400.0		400.0
Vencimiento de REPO Expansión del 24 al 28 de abril de 2017	0.0		0.0		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 Sustitucion el 26 de Mayo de 2017	243.0		243.0		243.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 24 al 28 de abril de 2017	0.0		0.0		0.0
xii. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3.5	3.5	3.5	3.5	7.0
Próximo vencimiento de SC-Compra el 30 mayo 2017	3.5		3.5		3.5
Vencimiento de SC - Venta del 24 al 28 de abril de 2017	0.0		0.0		0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0.0	0.0	3.2	317.9	411.9
ii. Ventas (millones de US\$)			1.0	38.0	127.0
Neto			2.2	279.9	284.9
Tipo de cambio promedio			3.2450	3.2440	3.2430
ii. Ventas (millones de US\$)					
iii. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
iv. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
v. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
vi. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
vii. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
viii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2 702.2	2 038.2	1 748.9	1 847.2	1 414.6
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%	0,0135%	0,0135%	0,0134%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	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					
Tasa de interés	1 088.9	712.4	213.8	44.0	519.0
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	1 613.3	1 325.9	1 535.1	1 803.2	985.6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 454.5	7 459.5	7 472.0	7 322.8	7 232.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.3	6.3	6.3	6.2	6.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 945.8	3 018.5	2 940.5	2 789.0	2 708.3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.5	2.5	2.5	2.4	2.3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	800.0	534.0	949.5	455.5	499.0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	5.0	9.5	0.0	94.0	65.0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,10/1,10/1,10	1,10/1,10/1,10		1,10/1,10/1,10	1,10/1,10/1,10
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	428.5	213.3	37.7	572.6	410.8
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	13,7 / 4,14		20,0 / 4,13		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	12 abril 17	17 abril 17	18 abril 17	19 abril 17	20 abril 17
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	-33.1	-25.5	-31.1	-35.0	-27.9
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	-18.5	-9.9	5.9	95.2	-37.7
a. Mercado spot con el público	9.7	-102.2	18.8	105.4	96.1
i. Compras	313.2	173.7	269.8	311.2	325.6
ii. (-) Ventas	303.5	276.0	241.9	205.8	229.5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	162.5	183.1	37.3	54.0	-31.4
i. Pactadas	197.0	209.9	320.5	134.0	172.1
ii. (-) Vencidas	34.5	26.8	283.2	80.0	203.4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	208.2	57.1	72.6	60.2	-46.5
i. Pactadas	294.0	136.7	169.1	155.1	230.5
ii. (-) Vencidas	85.8	79.6	96.5	94.9	277.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	572.9	337.4	294.8	502.5	436.8
ii. A futuro	5.0	0.0	7.0	7.0	5.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	3.8	-3.5	0.4	-2.8	-133.3
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datafeed)	3.2535	3.2505	3.2526	3.2493	3.2436
(*) Datos preliminares					