

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	29 Mayo 17	30 Mayo 17	31 Mayo 17	01 Junio 17	02 Junio 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 637,6	2 137,3	2 280,8	1 637,9	1 135,2
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)					
Propuestas recibidas	30,0		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	187,0		151,0	208,5	
Tasas de inte Mínima	171,4		525,4	371,4	
Máxima	3,81		3,88	3,85	
Promedio	3,85		3,90	3,85	
Saldo	3,84		3,88	3,85	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 06 de junio de 2017	27 683,4	27 683,4	27 713,4	27 743,4	27 743,4
Vencimiento de CD BCRP del 05 al 09 de junio de 2017	800,0		800,0		800,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas				1 500,0	100,0
Plazo de vencimiento				2 100,0	300,0
Tasas de inte Mínima				1,0	110,0
Máxima				4,01	1096,0
Promedio				4,25	4,35
Saldo				4,25	4,35
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 05 de junio de 2017	1 100,0	1 100,0	1 100,0	2 600,0	3 700,0
Vencimiento de REPO BCRP del 05 al 09 de junio de 2017	300,0		300,0		2 500,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas	0,0		0,0		0,0
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte 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	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 05 al 09 de junio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 20 de junio de 2017	100,0		100,0	100,0	100,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 05 al 09 de junio de 2017	0,0		0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 574,0	1 532,4	1 569,0	1 569,0	
Plazo de vencimiento	1,0	1,0	1,0	1,0	
Tasas de inte Mínima	3,25	3,30	3,20	3,20	
Máxima	3,46	3,35	3,40	3,40	
Promedio	3,41	3,47	3,38	3,38	
Saldo	900,0	1 500,0	1 569,0	1 569,0	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	800,0		1 569,0	1 569,0	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 05 al 09 de junio de 2017	0,0		0,0	0,0	
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte 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 05 al 09 de junio de 2017	0,0		0,0		0,0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
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 Coloc-BN el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Coloc - BN del 05 al 09 de junio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reaustables 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	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 05 al 09 de junio de 2017	0,0		0,0		0,0
vii. Compra con contrapartido de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	13 980,1	13 980,1	13 980,1	13 980,1	14 202,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 16 de junio de 2017	400,0		400,0		400,0
Vencimiento de REPO del 05 al 09 de junio de 2017	0,0		0,0		0,0
viii. Compra con contrapartido de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 350,0	6 350,0	6 350,0	6 350,0	5 950,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 09 de junio de 2017	400,0		400,0		200,0
Vencimiento de REPO Expansión del 05 al 09 de junio de 2017	400,0		400,0		200,0
ix. Compra con contrapartido de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 561,7	4 561,7	4 561,7	4 561,7	4 261,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 09 de junio de 2017	300,0		300,0		200,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 05 al 09 de junio de 2017	300,0		300,0		200,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	310,0	310,0	310,0	310,0	310,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de junio de 2017	260,0		260,0		260,0
Vencimiento de SC - Venta del 05 al 09 de junio de 2017	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	7,0	3,5	3,5	3,5	3,5
Próximo vencimiento de SC-Compra el 20 junio de 2017	3,5		3,5		3,5
Vencimiento de SC - Compra del 05 al 09 de junio de 2017	3,5		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
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\$)					
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					
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	707,6	637,3	681,8	3 107,9	3 735,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swap).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0138%	0,0137%	0,0138%	0,0138%	0,0128%
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 Overnigt en moneda nacional	206,2	318,8	114,3	60,0	160,0
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	501,4	318,5	567,5	8 047,9	3 575,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	6 476,4	6 514,8	6 387,6	7 392,3	7 128,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,4	5,4	5,3	7,4	6,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 151,9	2 092,0	2 042,9	1 985,7	2 783,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,8	1,8	1,7	3,0	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1 550,0	892,5	974,0	616,0	705,5
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	4.004,0/4,0/4,0	4,0/4,0/4,0	4,0/4,0/4,0	4,0/4,0/4,0	4,0/4,0/4,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR v CDV	1 234,3	584,9	746,8	307,0	1.001,0/1,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					307,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	26 mayo 17	29 mayo 17	30 mayo 17	31 mayo 17	01 junio 17
Flujo de la posición 2008a = a + b1 - c1 - e + f + g	-7,7	7,9	-17,1	46,5	-21,9
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	-24,4	195,1	-2,4	-111,8	-90,2
a. Mercado spot con el público					
i. Compras	51,8	-49,6	-137,5	6,7	-80,9
ii. (-) Ventas	214,5	196,4	227,9	242,5	251,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)					
i. (-) Ventas	269,3	190,3	277,5	380,0	342,2
ii. Compras forward al público (con y sin entrega)	14,8	-196,6	101,9	-23,9	354,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)					
i. (-) Ventas	102,6	80,8	259,8	404,9	218,3
ii. Compras forward al público (con y sin entrega)	87,7	277,3	101,3	305,0	242,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. A futuro	0,3	-8,4	17,7	-57,3	-82,4
ii. (-) Ventas	202,0	31,9	223,4	189,5	302,5
iii. Compras	201,7	41,3	48,7	246,8	364,8
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega					
i. Compras	416,2	273,2	555,9	581,5	355,3
ii. (-) Ventas	10,0	0,0	0,0	20,0	20,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
i. Compras	144,5	-89,4	-3,2	-29,9	153,8
ii. (-) Ventas	200,3	39,3	17,7	242,3	103,0
g. Efecto de Opciones					
i. (-) Ventas	55,7	106,7	49,9	271,2	210,3
ii. Compras	2,1	-0,2	0,3	-0,8	-0,1
h. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
i. Compras	-0,2	23,4	-1,1	-1,6	-0,6
ii. (-) Ventas					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datacel)	3,2738	3,2812	3,2862	3,2708	3,2698
(*) Datos preliminares					