

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	02 Mayo 17	03 Mayo 17	04 Mayo 17	05 Mayo 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 168,4	2 893,4	3 787,3	2 758,8
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				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	28 137,0	27 767,0	27 387,0	27 387,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de mayo de 2017	400,0	400,0	1 047,1	1 047,1
Vencimiento de CD BCRP del 8 al 12 de mayo de 2017	800,0	800,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1 000,0	800,0	300,0	500,0
Propuestas recibidas	1 600,0	1 950,0	650,0	775,0
Plazo de vencimiento	1 d	7 d	1 d	1 d
Tasas de Interés	4,25	4,42	4,45	4,25
Mínima	4,75	4,54	4,45	4,25
Máxima	4,48	4,49	4,45	4,25
Promedio	2 489,0	3 374,0	2 299,0	1 919,0
Saldo	1 000,0	1 575,0	500,0	120,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 8 de mayo de 2017	1 000,0	1 575,0	500,0	819,0
Vencimiento de REPO BCRP del 8 al 12 de mayo de 2017	1 000,0	1 575,0	500,0	819,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 8 al 12 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dolares del BCRP (CDLD BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	1 120,0	1 320,0	1 320,0	1 320,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 29 de mayo de 2017	70,0	70,0	70,0	70,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 8 al 12 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0
v. 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
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 8 al 12 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	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	300,1
Vencimiento de Coloc-TP del 8 al 12 de mayo de 2017	0,0	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 Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Coloc - BN del 8 al 12 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Revaluables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	150,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	150,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 8 al 12 de mayo de 2017	150,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	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	400,0
Vencimiento de REPO del 8 al 12 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	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	400,0
Vencimiento de REPO Expansión del 8 al 12 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	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	243,0	243,0	243,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 8 al 12 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	7,0	7,0	7,0	7,0
Próximo vencimiento de SC-Compra el 30 mayo 2017	7,0	7,0	7,0	7,0
Vencimiento de SC - Venta del 8 al 12 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
Tipo de cambio promedio (millones de US\$)				
ii. Ventas (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
Tipo de cambio promedio (millones de US\$)				
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	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTP				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 168,4	4 738,4	4 257,3	2 878,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0139%	0,0139%	0,0138%	0,0128%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	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%
d. Depósitos Overnigt en moneda nacional				
Tasa de interés	7,2	14,2	12,0	85,6
Promedio	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	3 161,2	4 724,2	4 245,3	2 793,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	6 964,4	7 528,9	6 907,9	7 171,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,8	6,9	5,8	6,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 280,5	3 074,1	2 613,2	2 922,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,9	2,8	2,2	2,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	469,5	628,5	691,5	827 500,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,30/4,26	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	43,0	84,0	110,0	114,0
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	15,0	10,0	101,4	101,4 / 4,07
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)	5,0 / 4,19			
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 abril 17	02 mayo 17	03 mayo 17	04 mayo 17
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-9,8	-70,0	-29,7	163,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-246,8	0,1	-173,0	174,4
a. Mercado spot con el público	42,5	-12,0	16,3	152,3
i. Compras	681,8	287,1	295,1	423,4
ii. (i) Ventas	319,3	299,2	278,8	271,1
Compras forward al público (con y sin entrega)	25,0	26,5	25,5	26,0
Pactadas	123,6	127,1	124,4	122,5
(i) Ventadas	123,6	100,6	106,9	293,4
Compras forward al público (con y sin entrega)	-116,5	94,2	99,3	-55,1
Pactadas	171,2	230,0	240,3	346,2
(i) Ventadas	287,6	135,8	141,0	401,3
ii. (ii) Ventas	517,8	338,8	332,0	609,1
Al contado	23,0	5,0	4,0	0,0
Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	170,9	56,9	46,1	126,1
Compras	278,1	109,5	109,5	400,3
(i) Ventas	107,3	52,6	24,4	274,2
Efecto de Opciones	0,1	-2,4	-10,9	-0,4
Operaciones netas con otras instituciones financieras	-296,1	-8,6	-111,3	3,9
Credito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datastat)	3,2439	3,2487	3,2509	3,2696
(*) Datos preliminares				