

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	08 Mayo 17	09 Mayo 17	10 Mayo 17	11 Mayo 17	12 Mayo 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 756.6	2 961.0	3 149.9	4 282.8	3 227.7
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	200.0	150.0
Plazo de vencimiento	131.0		207.4	478.3	529.0
Tasas de interés Mínima	188.4		547.4	182.3	181.4
Máxima	4.01		4.06	3.98	3.84
Promedio	4.07		4.10	3.99	3.90
Saldo	27 427.0	27 427.0	27 657.0	27 138.9	27 439.9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de mayo de 2017	1 047.1	1 047.1	1 047.1	300.0	300.0
Vencimiento de CD BCRP del 15 al 19 de mayo de 2017	1 047.1	1 047.1	1 047.1		900.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	350.0				
Plazo de vencimiento	1 d				
Tasas de interés Mínima	4.25				
Máxima	4.25				
Promedio	4.25				
Saldo	1 750.0	1 400.0	1 100.0	1 100.0	1 100.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 05 de junio de 2017	350.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de REPO BCRP del 15 al 19 de mayo de 2017	650.0	300.0			
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	0.0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 15 al 19 de mayo de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 320.0	1 320.0	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	70.0
Vencimiento de CDLD BCRP del 15 al 19 de mayo de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas				1 094.5	1 062.5
Plazo de vencimiento				1 d	3 d
Tasas de interés Mínima				3.60	3.50
Máxima				4.09	3.57
Promedio				3.87	3.53
Saldo				800.0	400.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 15 de mayo de 2017				800.0	400.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 15 al 19 de mayo de 2017				800.0	400.0
vi. 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 interés 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	300.1	300.1
Vencimiento de Coloc-TP del 15 al 19 de mayo de 2017	0.0	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	0.0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Coloc - BN del 15 al 19 de mayo de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
viii. 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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 15 al 19 de mayo de 2017	0.0	0.0	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	13 980.1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 16 de junio de 2017	400.0	400.0	400.0	400.0	400.0
Vencimiento de REPO del 15 al 19 de mayo de 2017	0.0	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	6 350.0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 02 de junio de 2017	400.0	400.0	400.0	400.0	400.0
Vencimiento de REPO Expansión del 15 al 19 de mayo de 2017	0.0	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	4 804.7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de mayo de 2017	243.0	243.0	243.0	243.0	243.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 15 al 19 de mayo de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	60.0	200.0	300.0	1.4	
Plazo de vencimiento	421.0	601.5	853.0		
Tasas de interés Mínima	63.0	62.4	62.4		
Máxima	-0.35	-0.30	-0.51		
Promedio	0.00	-0.06	-0.50		
Saldo	-0.20	-0.14	-0.51		
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de julio de 2017	60.0	260.0	560.0	560.0	560.0
Vencimiento de SC - Venta del 15 al 19 de mayo de 2017	60.0	260.0	260.0	260.0	260.0
xiii. 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	7.0
Próximo vencimiento de SC-Compra el 30 de mayo de 2017	3.5	3.5	3.5	3.5	3.5
Vencimiento de SC - Compra del 15 al 19 de mayo de 2017	0.0	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					
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	3 078.8	2 961.0	2 919.9	2 952.8	2 527.7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0137%	0.0137%	0.0137%	0.0137%	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. Derechos Overight en moneda nacional	35.6	107.5	123.0	43.7	49.0
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	3 043.0	2 853.5	2 796.9	2 909.1	2 033.7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 341.8	7 435.3	7 376.2	7 365.6	7 234.9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.2	6.2	6.2	6.1	6.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 086.3	3 143.9	3 039.4	3 036.5	2 936.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.6	2.6	2.5	2.5	2.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	852.5	1 202.0	1 185.5	687.5	1 433.0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	4 254 254.4,25	4 254 254.4,25	4 254 254.4,25	4 004 254.4,22	4 004 004.0,00
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	100.0	131.0	122.0	95.0	160.0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR v CDV	110.1/10.1/10.1	110.1/10.1/10.1	110.1/10.1/10.1	110.1/10.1/10.1	110.1/10.1/10.1
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	125.9	398.6	511.4	312.2	72.2
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		10.0 / 4.05			4.0 / 3.99
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)		10.0 / 4.07			28.2 / 4.01
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	05 mayo 17	08 mayo 17	09 mayo 17	10 mayo 17	11 mayo 17
Flujo de la posición global = a + b - c - e + f + g	7.5	5.2	60.8	-336.6	-23.1
Flujo de la posición contable = a + b - c - e + f + g	-46.3	-16.8	-6.8	-275.7	98.7
a. Mercado spot con el público	-15.1	-74.3	-6.9	-302.7	-23.5
i. Compras	348.6	246.2	233.9	292.1	228.9
ii. Ventas	363.8	320.5	240.8	564.9	252.4
b. Compras forwards al público (con y sin entrega)	155.7	72.7	75.3	-22.7	-198.7
i. Pactadas	175.0	180.0	110.0	120.8	117.0
ii. Ventas	19.8	107.3	37.7	143.6	225.7
c. Ventas forwards al público (con y sin entrega)	100.1	66.3	69.7	125.2	8.3
i. Pactadas	172.8	216.4	145.0	199.1	112.6
ii. Ventas	72.7	150.2	75.3	73.9	103.3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	474.3	484.6	445.8	963.3	262.8
ii. A futuro	3.0	40.0	5.0	0.0	0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	20.5	89.0	42.9	-40.8	3.6
i. Compras	30.8	142.5	72.8	73.9	102.4
ii. Ventas	10.3	43.5	30.0	114.7	98.8
f. Efecto de Opciones	0.3	-2.8	0.8	-4.2	-3.8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0.7	19.7	59.7	89.4	-3.9
h. Límites por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3.2720	3.2878	3.2879	3.2873	3.2861
(*) Datos preliminares					