

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	02 Abril 18	03 Abril 18	04 Abril 18	05 Abril 18	06 Abril 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	347,9	1 646,4	2 414,6	2 750,9	1 335,0
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
i. Operaciones monetarias arrojadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	50,0		50,0	50,0	
Plazo de vencimiento	271,5		158,0	360,5	
Tasas de interés	150,4		554,4	371,4	
Mínima	2,6		2,6	2,6	
Máxima	2,6		2,7	2,6	
Promedio	2,6		2,6	2,6	
Saldo	32 393,1	32 393,1	32 443,1	31 582,1	31 582,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de abril de 2018	911,0		911,0	911,0	1 613,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de abril de 2018	911,0		911,0	911,0	0,0
ii. Subasta de Comora Temoral de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1000,0	1500,0	2000,0	1000,0	1 600,0
Plazo de vencimiento	3205,0	3805,0	4700,0	3195,0	2 100,0
Tasas de interés	1,4	1,4	1,4	1,4	1,4
Mínima	2,87	2,84	2,76	2,81	2,75
Máxima	3,09	3,10	2,83	2,85	2,86
Promedio	2,93	2,90	2,79	2,84	2,81
Saldo	6 609,9	6 109,9	6 609,9	5 659,9	5 709,9
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 09 de abril de 2018	3 000,0		1 550,0	1 550,0	3 100,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 09 de abril de 2018	3 000,0		1 550,0	1 550,0	3 600,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD 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 CDLD BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. 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	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 200,0	1 200,0	1 200,0	1 200,0	1 200,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de junio de 2018	300,0		300,0	300,0	300,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 887,0	1 887,0	1 887,0	1 887,0	1 777,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 09 abril 2018	110,0		110,0	110,0	512,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 09 abril 2018	0,0		0,0	0,0	1 747,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7 300,1	7 000,1	6 700,1	6 100,1	6 100,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 20 de abril de 2018	500,0		600,0	600,0	200,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 550,0	3 550,0	3 550,0	3 550,0	3 050,0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 13 de Abril de 2018	500,0		500,0	500,0	600,0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 13 de Abril de 2018	500,0		500,0	500,0	600,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 530,0	3 530,0	3 530,0	3 530,0	3 530,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 20 de abril de 2018	150,0		150,0	150,0	150,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 20 de abril de 2018	0,0		0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 abril de 2018	500,0		500,0	500,0	500,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 abril de 2018	0,0		0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del 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 SC-Compra	0,0		0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0		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	0,0	0,0	0,0
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 y BTP					
i. Compras de CD BCRP y 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	4 797,9	4 146,4	3 914,6	3 350,9	2 935,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0078%	0,0078%	0,0078%	0,0078%	0,0088%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por requisição monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	32,4	11,2	10,1	22,2	5,0
Tasa de interés	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4 765,5	4 135,2	3 904,6	3 328,7	2 930,0
i. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 623,8	7 747,4	8 000,2	8 138,4	#REF!
ii. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	6,1	5,9	6,1	6,0	#REF!
iii. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 775,2	2 893,3	3 146,1	3 397,6	#REF!
iv. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	2,2	2,2	2,4	2,4	#REF!
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 135,0	1 623,0	1 673,0	1 396,0	1 120,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,75/2,80/2,76	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	29,0	60,5	41,0	53,5	136,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,75 / 1,75 / 1,75	1,75 / 1,75 / 1,75	1,75 / 1,75 / 1,75	1,75 / 1,75 / 1,75	1,75 / 1,75 / 1,75
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 Marzo 18	02 Abril 18	03 Abril 18	04 Abril 18	05 Abril 18
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	-2,4	-145,5	-145,5	-34,5	-61,9
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	25,6	103,3	93,2	42,7	-137,0
a. Mercado spot con el público	1,7	98,0	-73,6	27,4	-132,4
i. Compras	470,1	358,6	253,7	291,9	307,3
ii (-) Ventas	468,4	260,6	327,4	264,5	439,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	81,3	103,7	-34,9	86,5	-129,6
i. Pacifiadas	190,0	139,7	158,1	196,2	231,7
ii (-) Vencidas	108,7	136,0	193,0	109,6	421,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	107,8	63,1	12,1	98,3	-328,5
i. Pacifiadas	136,2	117,9	187,7	182,7	238,3
ii (-) Vencidas	228,3	54,9	186,5	84,4	564,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	511,5	403,5	780,0	919,3	1156,0
ii. A futuro	2,0	5,0	40,0	72,0	8,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	130,4	-32,5	-23,4	-7,4	-130,6
i. Compras	194,5	51,7	165,2	84,2	540,7
ii (-) Ventas	55,1	19,3	188,2	91,6	402,1
f. Efecto de Opciones	-1,5	-1,7	1,6	0,0	0,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	4,2	-8,3	-9,1	-2,6	0,3
h. Crédito por requisição monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2270	3,2262	3,2255	3,2272	3,2272
*1) Datos preliminares					