

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	25 Abril 16	26 Abril 16	27 Abril 16	28 Abril 16	29 Abril 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	754,2	1 477,7	1 866,3	2 340,7	2 048,5
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	151,0		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	30,0		85,0	121,0	
Tasas de Inter Mínima	171 d		533 d	343 d	
Máxima	4,45		4,70	4,75	
Promedio	4,50		4,70	4,85	
Saldo	4,48		4,70	4,79	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Mayo de 2016	17 025,2	17 025,2	17 055,2	17 085,2	17 085,2
Vencimiento de CD BCRP entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016					612,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	200	450	300,0	200,0	200,0
Propuestas recibidas	475	1518	425	785,0	785,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	7 d	7 d
Tasas de Inter Mínima	4,60	4,86	5,02	5,12	5,30
Máxima	4,66	4,86	5,03	5,12	5,30
Promedio	4,61	4,86	5,03	5,12	5,30
Saldo	1 150,0	856,0	800,0	1 000,0	1 200,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 4 de mayo de 2016					300,0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016					700,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
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 Repo Especial - CDR el 26 de Mayo de 2016					400,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016					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	160,0	160,0	160,0	160,0	160,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 20 mayo de 2016					160,0
Vencimientos de CDV BCRP entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 500,0	2 500,0	2 500,0	2 500,0	2 500,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 13 Mayo de 2016					300,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016					0,0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016					300,0
Vencimiento de Coloc - BN entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016					0,0
vii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas		33,0	91,0		
Plazo de vencimiento		33,0	91,0		
Tasas de Inter Mínima		91 d	91 d		
Máxima		0,75	0,75		
Promedio		0,75	0,75		
Saldo	5 716,0	5 449,0	5 385,0	5 385,0	5 085,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 3 de Mayo de 2016					285,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016					285,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	200,0				
Propuestas recibidas	300,0				
Plazo de vencimiento	732 d				
Tasas de Inter Mínima	5,06				
Máxima	5,17				
Promedio	5,12				
Saldo	16 000,0	16 000,0	16 000,0	16 000,0	16 000,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 2 de Mayo de 2016					300,0
Vencimiento de REPO entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016					0,0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017					300,0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016					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 Sustitución el 26 de Mayo de 2017					243,0
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016					0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	420,0	865,0	815,0	570,0	425,0
Propuestas recibidas	610,0	1 705,0	1 354,0	910,0	950,0
Plazo de vencimiento	91 d				
Tasas de Inter Mínima	0,41	0,40	0,50	0,45	0,45
Máxima	0,75	0,73	0,61	0,75	0,55
Promedio	0,57	0,57	0,55	0,49	0,49
Saldo	19 697,7	19 557,7	19 558,7	19 180,1	19 182,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 2 de Mayo de 2016					480,0
Vencimiento de SC - Venta entre el 2 y el 6 de Mayo de 2016					1 127,0
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
ii. Tipo de cambio promedio					
iii. Ventas (millones de US\$)					
iv. 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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	1 574,2	1 799,7	2 045,3	2 510,7	2 248,5
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%	0,0137%	0,0138%	0,0128%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	260,0		290,0		
Tasa de interés	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	1 057,6	1 026,9	1 847,1	820,0	968,5
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	776,6	770,8	488,2	1 690,7	1 280,0
i. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 295,8	4 295,8	4 295,8	4 295,8	4 295,8
ii. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	7,1	7,2	7,0	7,0	6,9
iii. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 324,3	2 185,3	2 111,6	2 051,5	2 024,9
iv. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	2,2	2,0	2,0	2,0	2,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 162,0	1 098,0	772,0	737,0	667,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,30 / 4,85 / 4,62	4,75 / 5,05 / 4,91	4,75 / 5,05 / 4,96	4,25 / 5,05 / 4,62	4,45 / 5,05 / 4,64
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	109,0	9,0	9,0	19,0	13,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,38 / 0,38 / 0,38	0,38 / 0,38 / 0,38	0,38 / 0,38 / 0,38	0,30 / 0,38 / 0,34	0,38 / 0,45 / 0,39
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR v CDV	69,0	24,0	65,0	30,0	10,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	23 / 4,60	23 / 4,60			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				30 / 4,70	
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	22 abril 16	25 abril 16	26 abril 16	27 abril 16	28 abril 16
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	-74,7	-21,1	-196,2	56,1	-133,7
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	4,0	-8,2	-311,8	-60,9	-14,5
a. Mercado spot con el público	-36,6	-18,6	-112,6	-47,6	-27,7
i. Compras	233,6	161,1	309,2	235,2	325,3
ii. (-) Ventas	272,3	179,7	421,8	282,7	302,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	28,3	-28,3	-28,3	26,1	-15,8
i. Pactadas	196,7	26,0	17,8	175,3	144,1
ii. (-) Ventas	168,4	53,4	226,5	149,2	159,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	92,4	-85,6	-85,6	-78,8	-9,1
i. Pactadas	207,1	74,9	138,1	143,9	119,8
ii. (-) Ventas	144,7	160,4	459,4	222,7	119,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1082,7	614,3	960,6	431,1	665,4
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	57,9	117,7	120,8	78,9	-89,4
f. Compras	143,5	341,3	341,3	220,4	83,0
g. (-) Ventas	85,6	40,9	220,4	143,5	152,4
h. Efecto de Opciones	10,1	9,6	30,8	0,0	-0,7
a. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-93,7	-60,9	-115,0	-4,7	-110,5
b. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datasec)	3,2708	3,2843	3,2836	3,2909	3,2776
(*) Datos preliminares					