

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	2 Mayo 16	3 Mayo 16	4 Mayo 16	5 Mayo 16	6 Mayo 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 105,5	3 440,8	2 971,5	3 810,4	3 369,0
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	111,0		126,1	162,1	
Tasas de Inter Mínima	192 d		554 d	371 d	
Máxima	4,49		4,60	4,60	
Promedio	4,60		4,90	4,80	
Saldo	17 115,2	17 115,2	17 145,2	17 175,2	17 175,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Mayo de 2016					612,0
Vencimiento de CD BCRP desde el 9 al 13 de Mayo de 2016					2 302,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	400	700	300,0	200,0	400,0
Plazo de vencimiento	1255	1520	1 250,0	400,0	720,0
Tasas de Inter Mínima	7 d	1 d	7 d	1 d	3 d
Máxima	5,30	4,50	5,36	4,50	4,33
Promedio	5,32	4,87	5,36	4,50	4,55
Saldo	2 300,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 9 de mayo de 2016					800,0
Vencimiento de Repo BCRP desde el 9 al 13 de Mayo de 2016					740,0
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					500,9
Vencimiento de Repo Especial - CDR desde el 9 al 13 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 desde el 9 al 13 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					
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo					
Vencimiento de Depósitos a Plazo desde el 9 al 13 de Mayo de 2016					
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
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 desde el 9 al 13 de Mayo de 2016					300,0
vii. 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 desde el 9 al 13 de Mayo de 2016					0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas		285,0			
Plazo de vencimiento		361,0			
Tasas de Inter Mínima		92 d			
Máxima		0,25			
Promedio		0,57			
Saldo	5 085,0	5 085,0	5 085,0	5 085,0	5 085,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 9 de Mayo de 2016					80,0
Vencimiento de CDR BCRP desde el 9 al 13 de Mayo de 2016					350,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas	300,0				
Plazo de vencimiento	833,0				
Tasas de Inter Mínima	730 d				
Máxima	5,16				
Promedio	5,23				
Saldo	16 000,0	16 000,0	16 000,0	16 000,0	16 000,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 31 de Mayo de 2016					300,0
Vencimiento de REPO desde el 9 al 13 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 Expansion el 17 de Enero de 2017					300,0
Vencimiento de REPO Expansion desde el 9 al 13 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 Sustitucion el 26 de Mayo de 2017					243,0
Vencimiento de REPO Sustitucion desde el 9 al 13 de Mayo de 2016					0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	205	275	220	300	340,0
Plazo de vencimiento	821	680	491	745	490,0
Tasas de Inter Mínima	92 d	92 d	92 d	92 d	92 d
Máxima	0,49	0,20	0,29	0,20	0,47
Promedio	0,70	0,39	0,29	0,49	0,69
Saldo	19 182,1	19 482,1	19 109,1	19 107,1	19 107,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de Mayo de 2016					35,0
Vencimiento de SC - Venta desde el 9 al 13 de Mayo de 2016					327,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
ii. Ventas (millones de US\$)					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
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	0,0
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 475,5	3 155,8	3 241,5	3 980,4	3 769,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0137%	0,0135%	0,0135%	0,0136%	0,0128%
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 Overnight en moneda nacional	412,0	423,7	423,8	419,7	417,9
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	3 063,5	2 732,1	2 817,7	3 560,7	3 351,1
a. 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
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	7,8	7,8	7,2	7,5	7,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 012,5	2 171,8	2 358,5	2 473,3	2 619,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	2,3	2,4	2,2	2,5	2,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	691,0	335,0	668,0	615,0	679,0
Tasa de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,80 / 4,80 / 4,80	4,50 / 4,80 / 4,79	4,80 / 4,80 / 4,80	4,80 / 4,80 / 4,80	4,80 / 4,80 / 4,80
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	27,0	73,0	84,0	122,0	110,0
Tasa de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,40 / 0,40 / 0,40	0,40 / 0,40 / 0,40	0,40 / 0,40 / 0,40	0,40 / 0,40 / 0,40	0,40 / 0,40 / 0,40
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	0,0	128,0	0,0	11,3
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\$)	29 abril 16	02 mayo 16	03 mayo 16	04 mayo 16	05 mayo 16
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	105,1	145,2	109,7	-35,9	9,3
Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + f + g	-2,1	20,6	20,6	50,5	32,5
a. Mercado spot con el público					
i. Compras	445,2	285,2	232,8	256,2	225,9
ii. (-) Ventas	347,6	156,7	136,0	196,9	295,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)					
i. Pacadas	118,9	148,9	46,5	134,8	31,2
ii. (-) Ventas	79,3	235,4	101,4	117,9	125,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)					
i. Pacadas	-58,0	-94,4	-47,9	0,5	-71,5
ii. (-) Ventas	162,4	110,1	190,3	189,6	181,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias	220,5	204,5	239,3	189,0	252,7
i. Al contado	678,4	464,9	199,0	567,2	545,5
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	27,0	4,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	129,3	-28,1	57,2	68,1	98,9
i. Compras	173,1	185,4	178,4	178,1	211,5
ii. (-) Ventas	43,8	213,6	94,3	112,0	112,6
f. Efecto de Opciones	1,7	-0,7	3,1	-0,8	-1,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-80,0	6,5	96,5	-105,7	-9,2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)					
[*] Usos preterminados	3,2744	3,2940	3,3347	3,3335	3,3197