

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	30 Mayo 16	31 Mayo 16	1 Junio 16	2 Junio 16	3 Junio 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 401,6	2 503,3	1 948,5	1 905,6	986,8
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)	30,0		30,0	30,0	
Propuestas recibidas	111,4	93,0	94,5	94,5	
Plazo de vencimiento	164 d	554 d	371 d	371 d	
Tasas de Inter Mínima	4,60	5,20	4,80	4,80	
Máxima	4,65	5,25	4,95	4,95	
Promedio	4,64	5,24	4,94	4,94	
Saldo	16 202,3	16 202,3	16 232,3	16 262,3	16 262,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 9 de Junio de 2016	1 259,1	1 259,1	1 259,1	1 259,1	1 259,1
Vencimiento de CD BCRP entre el 6 y el 10 de Junio de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	1 550,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas			3 535,0	1 300,0	1000
Plazo de vencimiento			1 d	7 d	30
Tasas de Inter Mínima			4,94	5,13	4,35
Máxima			5,00	5,36	5,05
Promedio			4,98	5,28	4,92
Saldo	500,0	500,0	1 800,0	2 800,0	3 500,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 6 de Junio de 2016	300,0	300,0	1 300,0	2 000,0	2 400,0
Vencimiento de Repo BCRP entre el 6 y el 10 de Junio de 2016	0,0	0,0	1 300,0	2 000,0	1 300,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 100,0	899,6	500,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR	200,4	400,0	500,0		
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 6 y el 10 de Junio de 2016	1 102,1	901,8	500,0		
iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de CDV BCRP entre el 6 y el 10 de Junio de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 324,5	1 202,0			
Plazo de vencimiento	1 324,5	1 202,0			
Tasas de Inter Mínima	1 d	1 d			
Máxima	4,09	4,11			
Promedio	4,25	4,25			
Saldo	1 324,5	1 202,0			
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	1 324,5	1 202,0			
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 6 y el 10 de Junio de 2016	0,0	0,0			
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 900,0	1 900,0	1 900,0	1 900,0	1 900,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 10 Junio de 2016	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 6 y el 10 de Junio de 2016	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 Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	300,0	300,0	300,0	300,0	0,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el	300,0	300,0	300,0	300,0	0,0
Vencimiento de Coloc - BN entre el 6 y el 10 de Junio de 2016	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 Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 333,1	3 970,7	3 970,7	3 549,0	3 549,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 6 de Junio de 2016	230,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 6 y el 10 de Junio de 2016	230,0	0,0	0,0	0,0	374,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	16 000,0	15 700,0	15 700,0	15 700,0	16 000,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 13 de Junio de 2016	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO entre el 6 y el 10 de Junio de 2016	300,0	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 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	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 6 y el 10 de Junio de 2016	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 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	243,0	243,0	243,0	243,0
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 6 y el 10 de Junio de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	554,0	465	1155	255,0	840,0
Plazo de vencimiento	92 d	92 d	92 d	92 d	92 d
Tasas de Inter Mínima	0,14	-0,01	0,00	-0,05	-0,06
Máxima	0,14	-0,01	0,19	-0,05	0,00
Promedio	0,11	-0,01	0,13	-0,05	-0,01
Saldo	18 791,4	19 142,2	18 782,3	18 791,6	18 601,8
Próximo vencimiento de SC-Venta el 7 de Junio de 2016	99,2	88,0	230,7	140,0	14,0
Vencimiento de SC - Venta entre el 6 y el 10 de Junio de 2016	417,9	318,7	230,7	14,0	14,0
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 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	1 047,1	1 233,3	3 018,5	3 895,6	3 986,8
4. Operaciones monetarias del BCR por el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0134%	0,0134%	0,0134%	0,0134%	0,0135%
c. Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Crédito por liquidez monetaria en moneda nacional	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
e. Depósitos Overnight en moneda nacional	4,65%	4,07%	3,94%	3,95%	4,03%
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	581,6	829,6	2 624,5	3 500,2	3 583,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 119,8	7 177,3	7 689,6	7 781,0	7 990,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEI)	6,8	6,8	10,0	9,7	7,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 083,7	2 143,5	2 624,5	2 745,6	2 944,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEI)	2,0	2,0	3,4	3,1	2,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 012,0	1 611,5	1 148,0	1 163,5	667,5
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,55/4,46	4,80/4,85/4,80	4,80/4,80/4,88	4,80/4,85/4,83
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	15,0	15,0	15,0	17,0	24,0
Tasas 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	0,40/0,45/0,41
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	3,2	6,0	0,0	23,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			6,0 / 5,20		23,5 / 4,95
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	27 mayo 16	30 mayo 16	31 mayo 16	01 junio 16	02 junio 16
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	-8,5	18,9	-12,2	-10,2	-14,7
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	113,8	8,1	-14,7	-30,8	-201,3
a. Mercado spot con el público	63,8	13,2	13,0	99,8	-99,8
i. Compras	250,0	152,5	253,3	240,3	182,5
ii. (-) Ventas	186,1	139,3	239,3	213,3	282,3
b. Compras forward al público (con y sin entresaca)	-75,4	-4,3	-78,3	9,0	-12,3
i. Pictadas	45,2	115,8	115,8	91,8	91,8
ii. (-) Vencidas	120,5	20,1	190,6	102,0	104,1
c. Ventas forward al público (con y sin entresaca)	125,5	45,3	-104,8	-26,2	-200,8
i. Pictadas	329,3	81,2	222,6	193,1	193,1
ii. (-) Vencidas	203,7	35,9	341,6	248,8	394,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	358,3	186,2	440,9	703,1	647,7
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	5,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	15,4	13,2	147,0	113,9	253,5
i. Compras	188,0	27,4	321,0	244,5	347,5
ii. (-) Ventas	112,6	14,2	174,0	106,6	94,0
f. Efecto de Opciones	0,9	0,9	0,9	-0,9	-0,9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	134,6	57,0	-4,4	-158,8	-62,6
h. Crédito por liquidez monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datastat)	3,3579	3,3622	3,3732	3,3778	3,3678
(*) Datos preliminares					