

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	03 Abril 17	04 Abril 17	05 Abril 17	06 Abril 17	07 Abril 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1,042.6	1,098.4	1,471.6	2,156.2	1,427.3
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	103.0		112.0	21.0	
Tasas de Inter	199.0		554.0	371.0	
Mínima	4.04		4.40	4.26	
Máxima	4.28		4.40	4.26	
Promedio	4.26		4.40	4.26	
Saldo	29,979.7	29,979.7	30,009.7	28,853.3	28,853.3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de abril de 2017	1,186.4		1,186.4		100.0
Vencimiento de CD BCRP del 10 al 12 de abril de 2017	1,186.4		1,186.4		1,876.5
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	2,200.0	1,650.0	1,650.0	850.0	1,350.0
Plazo de vencimiento	2,625.0	1,650.0	2,100.0	2,145.0	2,555.0
Tasas de Inter	1.0	1.0	1.0	1.0	3.0
Mínima	4.26	4.26	4.26	4.36	4.48
Máxima	4.40	4.40	4.35	4.55	4.61
Promedio	4.32	4.32	4.30	4.40	4.56
Saldo	3,699.0	3,149.0	3,149.0	2,349.0	2,849.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 10 de mayo de 2017	399.0		1,650.0		1,350.0
Vencimiento de REPO BCRP del 10 al 12 de abril de 2017	0.0		1,650.0		1,350.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
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 Repo Especial - CDR	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 10 al 12 de abril de 2017	0.0		0.0		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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el	0.0		0.0		0.0
Vencimientos de CDV BCRP del 10 al 12 de abril de 2017	0.0		0.0		0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
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 Depósitos a Plazo el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 10 al 12 de abril de 2017	0.0		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	1,600.0	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
Vencimiento de Coloc-TP del 10 al 12 de abril de 2017	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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de Coloc - BN del 10 al 12 de abril de 2017	0.0		0.0		0.0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reaustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	150.0	150.0	150.0	150.0	150.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 03 de mayo de 2017	150.0		150.0		150.0
Vencimiento de CDR BCRP del 10 al 12 de abril de 2017	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter					
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
Vencimiento de REPO del 10 al 12 de abril de 2017	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	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
Vencimiento de REPO Expansión del 10 al 12 de abril de 2017	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
Vencimiento de REPO Sustitución del 10 al 12 de abril de 2017	0.0		0.0		0.0
xii. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3.5	3.5	3.5	3.5	3.5
Próximo vencimiento de SC-Compra el 30 mayo 2017	3.5		3.5		3.5
Vencimiento de SC - Venta del 10 al 12 de abril de 2017	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					
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	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	3,212.6	2,748.4	3,091.6	2,976.2	2,777.3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0139%	0,0139%	0,0139%	0,0139%	0,0129%
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. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	0,0	5,0	10,0	0,0	10,0
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					
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	6.890,3	2.743,4	6.313,1	6.499,9	6.590,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,6	6,7	5,3	5,5	5,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	1.792,2	1.792,2	2.050,1	2.240,3	2.315,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	2,1	1,7	1,8	2,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de Inter: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	72,0	161,5	194,0	93,0
Tasas de Inter: Mínima / Máxima / Promedio		1,0/1,0/1,0	1,0/1,0/1,0	1,0/1,0/1,0	1,0/1,05/1,101
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	5,0	0,0	0,0	5,0	96,4
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	5,0 / 4,22				
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	31 marzo 17	03 abril 17	04 abril 17	05 abril 17	06 abril 17
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	-4	-51	-24	-22	-74
a. Mercado spot con el público	36,7	51,9	32,9	-54,1	131,3
i. Compras	71,6	61,1	58,8	-53,0	113,7
ii (-) Ventas	37,2	30,3	25,9	38,7	378,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	265,6	242,1	191,6	291,7	264,9
i. Pactadas	44,3	0,0	-12,1	38,3	-251,0
ii (-) Vencidas	73,2	38,7	132,0	217,1	57,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	26,9	36,7	144,1	180,8	308,9
i. Pactadas	89,8	94,8	23,1	-30,7	-204,8
ii (-) Vencidas	162,1	138,8	159,5	193,9	213,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias	73,3	44,0	172,8	190,1	418,7
i. Al contado	356,6	250,9	441,1	369,2	405,5
ii. A futuro	5,0	10,0	3,0	0,0	25,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-35,3	-1,3	-10,6	-3,2	0,2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2479	3,2479	3,2513	3,2480	3,2474
(*) Datos preliminares					