

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	24 Abril 17	25 Abril 17	26 Abril 17	27 Abril 17	28 Abril 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 443,6	2 925,1	2 323,6	2 159,2	1 786,0
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	100,0	100,0	30,0	100,0
Tasas de Inter Mínima	86,5	249,0	250,4	87,5	289,5
Máxima	178 d	177 d	359 d	357 d	175 d
Promedio	4,10	4,12	4,12	4,09	4,10
Saldo	4,14	4,12	4,12	4,12	4,10
Próximo vencimiento de CD BCRP el 2 de mayo de 2017	4,13	4,12	4,11	4,11	4,11
Vencimiento de CD BCRP del 2 al 5 de mayo de 2017	27 627,0	27 827,0	28 057,0	28 287,0	28 137,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	150,0	150,0	150,0	150,0	150,0
Propuestas recibidas					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 499,0	1 499,0	1 499,0	1 499,0	1 499,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 8 de mayo de 2017	399,0	399,0	399,0	399,0	399,0
Vencimiento de REPO BCRP del 2 al 5 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas					
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	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 2 al 5 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas	150,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Tasas de Inter Mínima	220,0	555,0	510	510	335
Máxima	60 d	61 d	61 d	61 d	61 d
Promedio	4,20	3,99	3,92	3,92	3,94
Saldo	4,20	4,08	3,98	3,98	4,07
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 29 de mayo de 2017	4,20	4,02	3,95	3,95	4,01
Vencimiento de CDLD BCRP del 2 al 5 de mayo de 2017	520,0	520,0	520,0	520,0	1 120,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	70,0	70,0	70,0	70,0	70,0
Tasas de Inter Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	1 600,0	1 600,0	1 300,0	1 043,1	800,0
Promedio	2 274,6	2 274,6	1 417,0	1 043,1	1 047,4
Saldo	1 d	1 d	1 d	1 d	4 d
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 02 de mayo de 2017	3,60	3,60	3,58	3,58	3,60
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 2 al 5 de mayo de 2017	3,73	3,73	4,20	4,24	4,00
vi. Subasta de Colocación DF en M.N. del Tesoro Público	3,62	3,62	3,78	3,82	3,60
Propuestas recibidas	1 600,0	1 158,1	1 300,0	1 043,1	800,0
Tasas de Inter Mínima	1 600,0	1 158,1	1 300,0	1 043,1	800,0
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	300,1	300,1
Vencimiento de Coloc-TP del 2 al 5 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Subasta de Colocación DF en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
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	0,0	0,0
Vencimiento de Coloc - BN del 2 al 5 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
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	150,0	150,0
Vencimiento de CDR BCRP del 2 al 5 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
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	400,0	400,0
Vencimiento de REPO del 2 al 5 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
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	400,0	400,0
Vencimiento de REPO Expansión del 2 al 5 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
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 del 2 al 5 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7,0	7,0	7,0	7,0	7,0
Próximo vencimiento de SC-Compra el 30 mayo 2017	3,5	3,5	3,5	3,5	3,5
Vencimiento de SC - Venta del 2 al 5 de mayo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	317,8	317,8	317,8	317,8	317,8
ii. Ventas (millones de US\$)	98,0	98,0	98,0	97,4	97,4
iii. Tipo de cambio promedio	3,2431			3,2450	3,2430
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	1 131,5	1 567,0	783,6	983,4	1 521,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0134%	0,0139%	0,0139%	0,0139%	0,0128%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de Interés	296,8	475,5	65,4	306,9	544,0
d. Deudatos Overnights en moneda nacional	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	834,7	1 091,5	728,2	676,6	977,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 101,7	7 155,4	6 943,0	6 898,4	6 877,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,0	6,0	5,9	5,8	5,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 558,5	2 643,7	2 411,9	2 359,0	2 309,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,2	2,2	2,0	2,0	2,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	510,5	541,0	404,0	630,5	1 032,5
Tasas de Interés: 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\$)	97,0	67,0	66,0	19,0	29,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,10 / 1,10 / 1,10	1,10 / 1,10 / 1,10	1,10 / 1,10 / 1,10	1,10 / 1,10 / 1,10	1,10 / 1,10 / 1,10
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	646,5	578,0	5,0	15,0	163,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	2,0 / 4,12				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			5,0 / 4,18		
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	21 abril 17	24 abril 17	25 abril 17	26 abril 17	27 abril 17
Flujo de la posición alfab. = a + b1 - c1 + e + f + g	-73,4	-33,5	-33,5	-132,3	-14,1
Flujo de la posición contable = a + b - c1 + e + f + g	-186,5	-128,5	-66,3	-21,7	-1,8
a. Mercado spot con público	73,3	30,2	94,5	3,5	54,6
i. Compras	294,2	216,6	219,9	386,0	331,5
ii. (-) Ventas	221,0	186,4	176,5	388,5	276,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	72,2	52,2	-54,6	-53,7	26,2
i. Factadas	105,6	92,6	106,9	388,6	113,6
ii. (-) Vencidas	33,5	40,4	161,5	452,2	87,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-41,0	-2,9	45,3	-230,1	38,3
i. Factadas	86,5	46,8	182,4	199,7	199,7
ii. (-) Vencidas	127,5	49,6	100,9	412,5	161,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	334,2	411,2	370,0	588,3	704,1
ii. A futuro	3,0	7,0	4,0	11,0	11,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	27,8	27,5	-44,2	-34,4	119,7
i. Compras	52,9	46,7	100,0	408,2	149,3
ii. (-) Ventas	25,1	19,2	144,2	440,6	29,6
f. Efecto de Opciones	-0,1	-1,7	0,0	7,5	-0,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-193,5	-177,0	-44,5	-25,5	-102,4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de Interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2427	3,2419	3,2462	3,2497	3,2473
8. Datos preliminares					