

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	22 Mayo 17	23 Mayo 17	24 Mayo 17	25 Mayo 17	26 Mayo 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 555,5	1 372,4	1 605,3	1 982,9	1 523,8
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)					
Propuestas recibidas	30,0		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	154,5		91,0	155,5	
Tasas de interés Mínima	175,9		53,3	327,4	
Máxima	3,88		3,92	3,88	
Promedio	3,88		3,92	3,88	
Saldo	27 593,4	27 593,4	27 623,4	27 653,4	27 653,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 06 de junio de 2017	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de CD BCRP del 29 de mayo al 02 de junio de 2017	0,0		0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	200,0	400,0			
Plazo de vencimiento	450,0	510,0			
Tasas de interés Mínima	7,4	1,4			
Máxima	4,15	4,19			
Promedio	4,21	4,22			
Saldo	1 700,0	1 300,0	1 300,0	1 300,0	1 300,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 29 de mayo de 2017	400,0		200,0		200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 29 de mayo al 02 de junio de 2017	400,0		0,0		200,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés 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 29 de mayo al 02 de junio de 2017	0,0		0,0		0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 320,0	1 320,0	1 320,0	1 320,0	1 320,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 29 de mayo de 2017	70,0		70,0		70,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 29 de mayo al 02 de junio de 2017	0,0		0,0		0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas				400,0	880,0
Plazo de vencimiento				1,4	3,4
Tasas de interés Mínima				3,45	3,40
Máxima				3,80	3,50
Promedio				3,61	3,46
Saldo				400,0	650,1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 29 de mayo de 2017					650,1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 29 de mayo al 02 de junio de 2017					650,1
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés 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 29 de mayo al 02 de junio de 2017	0,0		0,0		0,0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés 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 29 de mayo al 02 de junio de 2017	0,0		0,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Resaltables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 29 de mayo al 02 de junio de 2017	0,0		0,0		0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reoulari)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés 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 29 de mayo al 02 de junio de 2017	0,0		0,0		0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés 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 29 de mayo al 02 de junio de 2017	0,0		0,0		0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 561,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 2 de junio de 2017	243,0		243,0		300,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 29 de mayo al 02 de junio de 2017	0,0		243,0		300,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	310,0	310,0	310,0	310,0	310,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de julio de 2017	260,0		260,0		260,0
Vencimiento de SC - Venta del 09 de mayo al 02 de junio de 2017	0,0		0,0		0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7,0	7,0	7,0	7,0	7,0
Próximo vencimiento de SC-Compra el 30 de mayo de 2017	3,5		3,5		3,5
Vencimiento de SC - Compra del 29 de mayo al 02 de junio de 2017	0,0		0,0		3,5
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. 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 v BTP					
i. Compras de CD BCRP v 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	2 125,5	1 372,4	1 575,3	1 552,9	873,7
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%	0,0138%	0,0138%	0,0128%
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 Overnigt en moneda nacional	330,0	388,7	284,8	538,2	274,0
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	1 795,5	1 013,7	1 290,5	1 014,7	599,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	6 828,7	6 860,0	6 766,0	6 665,4	6 619,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,7	5,7	5,7	5,6	5,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 525,6	2 502,3	2 451,8	2 388,7	2 320,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,1	2,1	2,0	2,0	1,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4.004,0/0,0/0,0	4.004,0/0,0/0,0	4.004,0/5,4/0,0	4.004,0/0,0/0,0	4.004,0/0,0/0,0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,00/1,00/1,00	1,00/1,00/1,00	1,00/1,00/1,00	1,00/1,00/1,00	1,00/1,00/1,00
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR v CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	30,0	22,5	171,2	962,1	1 344,5
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	30,0/3,86			155,0/3,90	
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	19 mayo 17	22 mayo 17	23 mayo 17	24 mayo 17	25 mayo 17
Flujo de la posición 0008B = a + b1 - c1 - e + f + g	-15,9	17,3	-17,0	-7,7	-3,4
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	-2,5	-29,0	-2,2	9,8	30,7
a. Mercado spot con el público	-32,5	-75,2	-20,6	15,1	15,1
i. Compras	211,1	180,4	203,4	203,0	202,1
ii. (-) Ventas	243,6	255,6	274,0	223,5	222,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	58,2	-71,9	43,2	-61,7	13,4
i. Pactadas	106,9	131,3	171,3	79,9	219,2
ii. (-) Vendidas	47,7	203,2	128,1	141,5	205,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	45,0	-118,0	18,5	-58,8	47,1
i. Pactadas	86,7	138,1	137,7	116,6	310,1
ii. (-) Vendidas	41,7	256,1	119,2	147,4	263,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	170,3	286,4	304,2	307,5	545,2
ii. A futuro	15,0	0,0	0,0	20,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	35,4	102,0	28,1	56,4	73,2
i. Compras	38,2	190,4	192,4	146,1	262,2
ii. (-) Ventas	2,8	88,3	81,2	89,7	189,0
f. Efecto de Opciones	-1,2	0,2	-1,1	0,6	-0,4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-36,9	-2,9	-7,9	-20,3	-0,3
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2678	3,2737	3,2823	3,2748	3,2645
(*) Dato preliminar					