

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

| | 05 Junio 17 | 06 Junio 17 | 07 Junio 17 | 08 Junio 17 | 09 Junio 17 |
|--|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP | 1 587,7 | 2 409,9 | 2 602,6 | 3 296,0 | 2 815,1 |
| 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 | 252,4 | 30,0 | 30,0 | 60,0 |
| Plazo de vencimiento | 215,5 | 547,4 | 302,2 | 302,2 | 350,0 |
| Tasas de interés Mínima | 3,76 | 3,82 | 3,75 | 3,75 | 3,75 |
| Máxima | 3,83 | 3,86 | 3,82 | 3,82 | 3,82 |
| Promedio | 3,81 | 3,85 | 3,81 | 3,85 | 3,81 |
| Saldo | 27 773,4 | 26 973,4 | 27 003,4 | 26 003,3 | 26 003,3 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de junio de 2017 | 800,0 | 1 030,1 | 1 030,1 | 1 030,1 | 60,0 |
| Vencimiento de CD BCRP del 12 al 16 de junio de 2017 | 1 830,1 | 1 830,1 | 1 830,1 | 1 830,1 | 0,0 |
| ii. Subasta de Comora Temporal de Valores (REPO) | 2 000,0 | 750,0 | 400,0 | 400,0 | 150,0 |
| Propuestas recibidas | 2 200,0 | 1 050,0 | 400,0 | 400,0 | 350,0 |
| Plazo de vencimiento | 1 d | 1 d | 1 d | 1 d | 384 d |
| Tasas de interés Mínima | 4,0 | 4,00 | 4,00 | 4,00 | 4,45 |
| Máxima | 4,1 | 4,11 | 4,04 | 4,04 | 4,45 |
| Promedio | 4,1 | 4,09 | 4,03 | 4,03 | 4,45 |
| Saldo | 3 200,0 | 1 950,0 | 1 600,0 | 1 200,0 | 1 350,0 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 20 de junio de 2017 | 2 000,0 | 400,0 | 400,0 | 400,0 | 300,0 |
| Vencimiento de REPO BCRP del 12 al 16 de junio de 2017 | 2 000,0 | 2 000,0 | 2 000,0 | 2 000,0 | 0,0 |
| iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR) | | | | | |
| Propuestas recibidas | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Plazo de vencimiento | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tasas de interés Mínima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Máxima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| 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 12 al 16 de junio de 2017 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Plazo de vencimiento | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tasas de interés Mínima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Máxima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Saldo | 1 250,0 | 1 250,0 | 1 250,0 | 1 250,0 | 1 250,0 |
| Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 20 de junio de 2017 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 |
| Vencimiento de CDLD BCRP del 12 al 16 de junio de 2017 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | | | | | |
| Propuestas recibidas | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 300,0 | 0,0 |
| Plazo de vencimiento | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 1 031,2 | 1 d |
| Tasas de interés Mínima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 3,40 | 3,40 |
| Máxima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 3,42 | 3,41 |
| Promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 3,41 | 3,41 |
| Saldo | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 300,0 | 0,0 |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo del 12 al 16 de junio de 2017 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Propuestas recibidas | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Plazo de vencimiento | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tasas de interés Mínima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Máxima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Saldo | 1 600,0 | 1 600,0 | 1 600,0 | 1 300,0 | 1 300,0 |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 05 de julio de 2017 | 300,1 | 300,1 | 300,1 | 300,1 | 500,0 |
| Vencimiento de Coloc-TP del 12 al 16 de junio de 2017 | 300,1 | 300,1 | 300,1 | 300,1 | 0,0 |
| vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación | | | | | |
| Propuestas recibidas | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Plazo de vencimiento | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tasas de interés Mínima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Máxima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| 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 12 al 16 de junio de 2017 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Plazo de vencimiento | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tasas de interés Mínima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Máxima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Saldo | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Vencimiento de CDR BCRP del 12 al 16 de junio de 2017 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reouarl) | | | | | |
| Propuestas recibidas | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Plazo de vencimiento | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tasas de interés Mínima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Máxima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Saldo | 14 202,1 | 14 202,1 | 14 202,1 | 14 202,1 | 14 352,1 |
| 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 12 al 16 de junio de 2017 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 400,0 |
| viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión) | | | | | |
| Propuestas recibidas | 5 950,0 | 5 950,0 | 5 950,0 | 5 950,0 | 5 750,0 |
| Plazo de vencimiento | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 800,0 |
| Tasas de interés Mínima | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 |
| Máxima | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 |
| Promedio | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 |
| Saldo | 4 261,7 | 4 261,7 | 4 261,7 | 4 261,7 | 4 061,7 |
| Próximo vencimiento de Repo Expansión el 07 de julio de 2017 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 |
| Vencimiento de REPO Expansión del 12 al 16 de junio de 2017 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 0,0 |
| ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución) | | | | | |
| Propuestas recibidas | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Plazo de vencimiento | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tasas de interés Mínima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Máxima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Saldo | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 16 de junio de 2017 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 |
| Vencimiento de REPO Sustitución del 12 al 16 de junio de 2017 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 | 200,0 |
| x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | | | | | |
| Propuestas recibidas | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Plazo de vencimiento | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tasas de interés Mínima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Máxima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Saldo | 310,0 | 308,0 | 308,0 | 308,0 | 308,0 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de julio 2017 | 260,0 | 250,0 | 250,0 | 250,0 | 250,0 |
| Vencimiento de SC - Venta del 12 al 16 de junio de 2017 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP | | | | | |
| Propuestas recibidas | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Plazo de vencimiento | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tasas de interés Mínima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Máxima | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Saldo | 3,5 | 3,5 | 3,5 | 3,5 | 3,5 |
| Próximo vencimiento de SC-Compra el 20 junio 2017 | 3,5 | 3,5 | 3,5 | 3,5 | 3,5 |
| Vencimiento de SC - Compra del 12 al 16 de junio 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\$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tipo de cambio promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| ii. Ventas (millones de US\$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tipo de cambio promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$) | | | | | |
| i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| 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 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 3 557,7 | 3 159,9 | 2 972,6 | 2 966,0 | 3 115,1 |
| 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 | 193,0 | 171,6 | 163,3 | 188,5 | 199,2 |
| 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 | 3 364,7 | 2 988,3 | 2 777,5 | 2 777,5 | 2 915,9 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*) | 7 638,2 | 7 573,2 | 7 564,9 | 7 612,3 | 7 576,4 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 6,4 | 6,3 | 6,4 | 6,4 | 6,3 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 3 322,2 | 3 427,6 | 3 333,3 | 3 275,3 | 3 236,5 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 2,8 | 2,7 | 2,8 | 2,7 | 2,7 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 907,0 | 1 038,0 | 886,0 | 970,5 | 1 594,5 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,004/4,004/0,00 | 4,004/4,004/0,00 | 4,004/4,004/0,00 | 4,004/4,004/0,00 | 4,004/4,004/0,00 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 176,0 | 157,0 | 136,0 | 177,0 | 60,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 1,001/1,001/0,00 | 1,001/1,001/0,00 | 1,001/1,001/0,00 | 1,001/1,001/0,00 | 1,001/1,001/0,00 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR v CDV | 53,3 | 0,0 | 0,0 | 21,5 | 132,5 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | 1,0 / 3,80 | |
| Plazo 18 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 02 Junio 17 | 05 Junio 17 | 06 Junio 17 | 07 Junio 17 | 08 Junio 17 |
| Flujo de la posición 00000 = a + b1 - c1 - e + f + g | 17,1 | 21,5 | 65,1 | -96,0 | 71,0 |
| Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 - e + f + g | 80,8 | -4,1 | -47,4 | 13,6 | 211,9 |
| a. Mercado spot con el público | 42,9 | -39,3 | -39,3 | -17,5 | -94,9 |
| i. Compras | 223,0 | 208,9 | 218,9 | 218,0 | 160,0 |
| ii. (-) Ventas | 180,1 | 248,2 | 269,0 | 235,5 | 255,0 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | -40,1 | 73,2 | 103,4 | -35,1 | -387,5 |
| i. Pactadas | 65,6 | 113,6 | 179,9 | 95,5 | 144,1 |
| ii. (-) Vendidas | 105,6 | 40,3 | 76,5 | 130,6 | 511,6 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 23,7 | 47,1 | -15,5 | 77,4 | -227,4 |
| i. Pactadas | 77,4 | 77,1 | 259,1 | 230,2 | 230,2 |
| ii. (-) Vendidas | 53,7 | 30,0 | 274,6 | 152,8 | 457,6 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 274,5 | 264,6 | 257,9 | 448,3 | 421,5 |
| ii. A futuro | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 15,0 | 17,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | -8,2 | 25,8 | 205,9 | 93,0 | 259,9 |
| i. Compras | 47,8 | 27,3 | 272,9 | 105,6 | 45 |