

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	16 Abril 18	17 Abril 18	18 Abril 18	19 Abril 18	20 Abril 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 665,3	3 595,7	2 903,3	1 408,2	1 055,8
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
i. Operaciones monetarias arrojadas del BCR					
I. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	50,0	200,0	200,1	200,0	50,0
Propuestas recibidas	250,5	704,9	998,9	900,0	279,0
Plazo de vencimiento	176 d	176 d	84 d	175 d	540 d
Tasas de Inter Mínima	2,54	2,60	2,63	2,60	2,64
Máxima	2,65	2,62	2,65	2,63	2,70
Promedio	2,62	2,61	2,64	2,60	2,68
Saldo	28 205,8	27 641,0	27 951,5	27 541,5	27 541,5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 08 de mayo de 2018	964,9		660,0		1 026,1
Vencimiento de CD BCRP del 23 al 27 de abril de 2018	1 624,9		660,0		0,0
II. Subasta de Comora Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 109,9	2 109,9	2 109,9	2 109,9	2 409,9
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 23 de mayo de 2018	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO BCRP del 23 al 27 de abril de 2018	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 Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 23 al 27 de abril de 2018	0,0		0,0		0,0
IV. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	999,9	500,0	1000,0	1000,0	500,1
Propuestas recibidas	1411,0	1276,8	1733,0	1382,9	500,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de Inter Mínima	2,29	2,14	2,30	2,15	2,19
Máxima	2,73	2,47	2,61	2,34	2,46
Promedio	2,50	2,37	2,50	2,26	2,32
Saldo	1 499,9	1 600,0	1 000,0	1 000,0	1 000,1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	1 499,9		1 000,0		1 000,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 23 al 27 de abril de 2018	1 499,9		1 000,0		1 000,0
V. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 200,0	1 200,0	1 200,0	1 200,0	1 200,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de junio de 2018	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 23 al 27 de abril de 2018	0,0		0,0		0,0
VI. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR 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 CDR BCRP el	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 23 al 27 de abril de 2018	0,0		0,0		0,0
VII. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 100,1	6 100,1	6 100,1	6 100,1	5 900,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 23 de abril de 2018	200,0		200,0		117,0
Vencimiento de REPO del 23 al 27 de abril de 2018	0,0		0,0		317,0
VIII. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 450,0	2 450,0	2 450,0	2 450,0	2 450,0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 27 de Abril de 2018	600,0		600,0		600,0
Vencimiento de REPO Expansión del 23 al 27 de abril de 2018	0,0		0,0		0,0
IX. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 530,0	3 530,0	3 530,0	3 530,0	3 380,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 04 de mayo de 2018	150,0		150,0		400,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 23 al 27 de abril de 2018	0,0		0,0		0,0
X. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 27 abril de 2018	200,0		200,0		200,0
Vencimiento de SC - Venta del 23 al 27 de abril de 2018	0,0		0,0		0,0
XI. Subasta de Swap Cambiario Compra del 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 SC-Compra	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de SC - Compra del 23 al 27 de abril de 2018	0,0		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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 y BTP					
I. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
II. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 915,4	1 595,6	1 598,3	1 103,2	1 355,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	0,0078%	0,0078%	0,0078%	0,0078%	0,0088%
Comisión (tasa efectiva diaria)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
Tasa de interés					
c. Crédito por liquidez monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	395,0	65,0	96,0	123,4	320,0
Tasa de interés	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 520,4	1 330,6	1 502,3	979,8	1 035,8
i. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 756,3	7 754,4	7 663,6	7 556,2	7 496,2
Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,8	5,7	5,7	5,6	5,6
Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 899,5	2 904,3	2 826,4	2 750,1	2 664,3
Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,2	2,1	2,1	2,0	2,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	701,0	521,5	1 010,5	1 094,6	1 115,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	295,5	292,5	277,0	231,3	196,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,75 / 1,80 / 1,76	1,75 / 1,80 / 1,76	1,75 / 1,80 / 1,76	1,75 / 1,75 / 1,75	1,75 / 1,75 / 1,75
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	0,0	0,0	100,0	109,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	12 Abril 18	16 Abril 18	17 Abril 18	18 Abril 18	19 Abril 18
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	0,7	-85,2	73,6	15,4	28,7
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	0,2	-94,3	22,1	105,9	70,6
a. Mercado spot con el público	0,7	-119,5	16,2	86,8	64,0
I. Compras	2,0	343,9	360,2	360,1	555,9
II (-) Ventas	1,3	463,4	343,9	273,3	491,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-0,4	167,7	43,4	77,3	-217,4
I. Placitadas	0,0	249,4	137,9	162,5	188,2
II (-) Vencidas	0,4	81,7	94,5	85,2	385,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-0,3	69,1	-5,3	166,3	-182,3
I. Placitadas	0,0	133,0	213,0	405,0	242,6
II (-) Vencidas	0,3	64,0	216,4	238,7	424,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
I. Al contado	0,0	811,3	462,3	1068,7	823,3
II. A futuro	0,0	0,0	0,0	20,0	10,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	0,0	21,0	127,0	165,5	42,9
I. Compras	0,0	24,8	213,1	235,4	395,5
II (-) Ventas	0,0	3,8	85,8	69,9	352,7
f. Efecto de Opciones	0,0	1,6	2,7	-1,5	-3,8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	-74,7	0,5	7,1	3,2
h. Crédito por liquidez monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2278	3,2231	3,2196	3,2162	3,2197
(*) Datos preliminares					