

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	23 Abril 18	24 Abril 18	25 Abril 18	26 Abril 18	27 Abril 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	-227,9	138,5	903,6	1 466,3	206,2
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias arrojadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CD BCRP)	50,0		50,0	50,0	
Propuestas recibidas	295,0		161,0	161,0	
Plazo de vencimiento	178 d		533 d	860 d	
Tasas de Inter Mínima	2,54		2,58	2,6	
Máxima	2,59		2,70	2,6	
Promedio	2,58		2,69	2,6	
Saldo	27 591,5	27 591,5	27 641,5	27 491,5	27 491,5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 08 de mayo de 2018	200,0		200,0	200,0	1 026,1
Vencimiento de CD BCRP del 30 de abril al 04 de mayo de 2018	0,0		0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Comora Temoooral de Valores (REPO)	300,0	200,0	1030,0	600,0	200,0
Propuestas recibidas	955,0	630,0	1030,0	1 450,0	200,0
Plazo de vencimiento	1 d	7 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de Inter Mínima	2,92	2,91	2,75	2,82	2,75
Máxima	2,92	2,91	2,85	2,93	2,75
Promedio	2,92	2,91	2,86	2,91	2,75
Saldo	3 639,9	2 909,9	2 909,9	2 309,9	2 309,9
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 30 de abril de 2018	1 330,0		2 309,9	2 509,9	200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 30 de abril al 04 de mayo de 2018	1 330,0		200,0	0,0	200,0
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	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 30 de abril al 04 de mayo de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. 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	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 30 de abril al 04 de mayo de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público		500,0			500,0
Propuestas recibidas		1 410,3		1 005,9	1 005,9
Plazo de vencimiento		183 d		185 d	185 d
Tasas de Inter Mínima		3,18		3,28	2,98
Máxima		3,31		3,35	3,35
Promedio		3,25		3,20	3,16
Saldo	1 200,0	1 700,0	1 700,0	1 700,0	2 200,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de junio de 2018	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 30 de abril al 04 de mayo de 2018					
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	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 30 de abril al 04 de mayo de 2018	0,0	0,0	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	5 783,1	5 783,1	5 783,1	5 783,1	5 583,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 02 de mayo de 2018	200,0		200,0	200,0	300,0
Vencimiento de REPO del 30 de abril al 04 de mayo de 2018	200,0		200,0	200,0	300,0
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	1 850,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 11 de Mayo de 2018	600,0		600,0	600,0	600,0
Vencimiento de REPO Expansión del 30 de abril al 04 de mayo de 2018	0,0		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	3 380,0	3 380,0	3 380,0	3 380,0	3 380,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 04 de mayo de 2018	400,0		400,0	400,0	400,0
Vencimiento de REPO Sustitucion del 30 de abril al 04 de mayo de 2018	0,0		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	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el	200,0		200,0	200,0	0,0
Vencimiento de SC - Venta del 30 de abril al 04 de mayo de 2018	0,0		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	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 30 de abril al 04 de mayo de 2018	0,0		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	1 252,1	1 238,5	853,6	1 416,3	706,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	0,0088%	0,0078%	0,0078%	0,0078%	0,0078%
Comisión (tasa efectiva diaria)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	26,5	555,0	100,0	621,8	21,8
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	1 225,7	683,5	753,6	794,5	684,4
i. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 340,9	7 353,4	7 155,8	7 000,2	6 944,3
ii. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,5	5,5	5,3	5,2	5,2
iii. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 511,5	2 383,2	2 318,0	2 194,1	2 138,2
iv. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,9	1,7	1,7	1,6	1,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	857,9	1 173,7	1 272,0	1 393,1	1 831,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75	2,75/2,80/2,75	2,75/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	225,0	232,0	200,0	397,0	196,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,75 / 1,80 / 1,76	1,75 / 1,75 / 1,75	1,75 / 1,75 / 1,75	1,75 / 1,75 / 1,75	1,75 / 1,75 / 1,75
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	47,2	40,0	30,0	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	47,2 / 2,58				
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	20 Abril 18	23 Abril 18	24 Abril 18	25 Abril 18	26 Abril 18
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	100,4	-248,0	137,8	-72,6	-20,7
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	189,2	-206,0	-52,0	-86,6	14,0
a. Mercado spot con el público	173,5	-170,4	-14,8	-24,1	-88,8
i. Compras	443,4	353,0	263,3	246,1	326,2
ii (-) Ventas	269,9	523,4	293,3	270,3	395,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	93,9	-11,7	149,6	-6,1	-31,6
i. Placadas	114,2	67,1	316,9	166,4	177,6
ii (-) Vencidas	20,3	78,8	167,3	172,4	209,2
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	182,0	32,9	-86,5	12,3	-79,9
i. Placadas	194,4	129,5	194,4	264,4	239,3
ii (-) Vencidas	12,4	96,7	227,7	252,1	319,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1139,3	1322,8	1237,3	1480,0	1204,6
ii. A futuro	20,0	5,0	32,0	10,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	11,2	-9,8	62,1	75,0	14,0
i. Compras	11,8	21,5	225,6	243,0	317,0
ii (-) Ventas	0,6	31,4	163,5	168,0	202,1
f. Efecto de Opciones	-0,7	-0,4	-0,4	-2,2	-0,5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-3,3	-7,9	-78,9	-23,2	-4,7
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)					
(*) Datos preliminares	3,2235	3,2305	3,2321	3,2411	3,2363