

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	06 Marzo 17	07 Marzo 17	08 Marzo 17	09 Marzo 17	10 Marzo 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 158,8	3 425,2	3 684,9	4 755,7	4 853,6
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	100,0	100,0
Plazo de vencimiento	163,0		30,0	100,0	100,0
Tasas de Inter. Mínima	185 d		547 d	32 d	89 d
Máxima	4,16		4,79	4,35	4,30
Promedio	4,51		4,79	4,26	4,34
Saldo	4,45		4,37	4,26	4,33
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de marzo de 2017	28 296,0	28 186,0	28 125,0	27 465,8	27 465,8
Vencimiento de CD BCRP del 13 al 17 de marzo de 2017	100,0	200,0	889,2	200,0	186,0
Saldo	1 389,2	1 289,2	1 089,2	200,0	586,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	300,0				
Plazo de vencimiento	910,0				
Tasas de Inter. Mínima	1 d				
Máxima	4,35				
Promedio	4,35				
Saldo	4,35				
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 08 de mayo de 2017	1 799,0	1 499,0	1 499,0	1 499,0	1 499,0
Vencimiento de REPO BCRP del 13 al 17 de marzo de 2017	300,0	399,0	399,0	399,0	399,0
Saldo	300,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
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 Repo Especial - CDR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 13 al 17 de marzo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV 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 CDV BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de CDV BCRP del 13 al 17 de marzo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas				1 132,8	263,5
Plazo de vencimiento				1 132,8	273,5
Tasas de Inter. Mínima				1 d	7 d
Máxima				3,89	4,15
Promedio				4,25	4,20
Saldo	0,0	0,0	0,0	4,15	4,09
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 10 de marzo de 2017	0,0	0,0	0,0	1 132,8	1 363,5
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 13 al 17 de marzo de 2017	0,0	0,0	0,0	1 132,8	1 100,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	1 132,8	1 363,5
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter. 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	300,1	300,1
Vencimiento de Coloc-TP del 13 al 17 de marzo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
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 Coloc-BN el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Coloc-BN del 13 al 17 de marzo 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	150,0	150,0	150,0	150,0	150,0
Plazo de vencimiento	150,0	150,0	150,0	150,0	150,0
Tasas de Inter. Mínima	61 d	61 d	61 d	61 d	61 d
Máxima	0,40	0,40	0,40	0,40	0,40
Promedio	0,70	0,70	0,70	0,70	0,70
Saldo	0,52	0,52	0,52	0,52	0,52
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 13 al 17 de marzo de 2017	150,0	150,0	150,0	150,0	150,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reaular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
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 13 al 17 de marzo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
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 13 al 17 de marzo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
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 13 al 17 de marzo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta 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-Venta el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Venta del 13 al 17 de marzo de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	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					
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	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	3 428,8	3 425,2	3 554,9	3 392,9	3 290,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0137%	0,0137%	0,0137%	0,0137%	0,0127%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés	10,0	22,0	19,0	19,0	619,0
d. Depósitos Overnights en moneda nacional	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
Tasa de interés					
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 418,8	3 403,2	3 535,9	3 379,9	2 671,1
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 656,1	8 637,7	8 656,1	8 637,7	8 570,7
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,4	7,4	7,4	7,4	7,3
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 603,8	3 595,1	3 625,3	3 578,5	3 503,4
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,1	3,1	3,1	3,1	3,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	641,5	1 208,0	1 007,0	1 139,0	583,0
Tasas de Inter. 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\$)	149,0	182,5	182,5	189,0	134,0
Tasas de Inter. Mínima / Máxima / Promedio	0,75/0,75/0,75	0,75/0,75/0,75	0,75/0,75/0,75	0,75/0,75/0,75	0,75/0,75/0,75
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	25,0 / 4,48	13,0 / 4,50	0,0	10,0 / 4,45	11,0 / 4,50
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					30,8 / 4,62
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	03 marzo 17	06 marzo 17	07 marzo 17	08 marzo 17	09 marzo 17
Flujo de la posición global = a + b i - c i + e + f + g	-77,0	-3,8	-25,6	-21,4	62,8
Flujo de la posición contable = a + b i - c i + e + g	36,8	76,3	34,7	45,8	-98,0
a. Mercado spot con el público	52,9	63,4	36,9	50,6	-93,1
i. Compras	229,9	292,3	235,0	184,7	219,7
ii (-) Ventas	177,0	188,9	198,1	134,2	312,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-11,2	74,2	-10,4	70,3	109,2
i. Pactadas	87,0	102,0	155,8	164,9	237,6
ii (-) Vendidas	98,1	27,8	166,2	94,6	128,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	95,4	159,7	50,0	129,6	-52,9
i. Pactadas	224,2	230,4	132,3	230,8	75,8
ii (-) Vendidas	128,8	70,7	82,3	78,2	128,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	330,8	283,2	430,2	385,7	485,9
ii. A futuro	6,0	0,0	6,0	13,1	6,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	31,3	55,0	-82,5	-14,1	2,6
i. Compras	115,5	70,0	80,5	78,0	127,3
ii (-) Ventas	84,2	15,0	163,0	92,2	124,7
f. Efecto de Opciones	-7,3	5,4	0,2	-7,8	-1,4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-17,9	0,8	-5,7	-7,1	-7,2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datarec)	3,2855	3,2914	3,2931	3,2932	3,2952
11 Datos primarios					