

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	23 Enero 17	24 Enero 17	25 Enero 17	26 Enero 17	27 Enero 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2,249.5	2,512.3	3,069.8	3,155.1	2,881.7
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	100.0	100.0	30.0	100.0
Plazo de vencimiento	137.0	222.0	262.0	134.0	432.0
Tasas de interés	168.4	85.4	169.4	167.4	169.4
Máxima	4.41	4.34	4.45	4.44	4.41
Promedio	4.48	4.35	4.47	4.45	4.45
Saldo	24,592.1	24,632.1	24,922.1	25,052.1	25,252.1
Vencimiento de CD BCRP el 9 de febrero de 2017	1,023.2	1,023.2	1,023.2	1,023.2	1,023.2
Vencimiento de CD BCRP del 30 de enero al 3 de febrero de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,199.0	1,199.0	1,199.0	1,199.0	1,199.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 08 de mayo de 2017	399.0	399.0	399.0	399.0	399.0
Vencimiento de REPO BCRP del 30 de enero al 3 de febrero de 2017	0.0	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 interés					
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 30 de enero al 3 de febrero 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 interés					
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 30 de enero al 3 de febrero de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	453.9	1,200.0	256.5	200.0	1,455.1
Plazo de vencimiento	453.9	1,200.0	1,446.0	208.5	1,455.1
Tasas de interés	1.0	1.0	1.0	1.0	1.0
Máxima	3.90	4.00	4.15	4.18	4.10
Promedio	4.25	4.24	4.25	4.25	4.25
Saldo	1,140.3	1,886.4	4.20	4.22	4.19
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo del 26 de enero de 2017	453.9	1,399.9	1,743.0	2,198.1	1,960.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 3 de febrero de 2017	853.8	1,886.4	1,486.5	1,741.6	1,503.5
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
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 30 de enero al 3 de febrero 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 interés					
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 30 de enero al 3 de febrero de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reaustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	225.0	225.0	225.0	225.0	225.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 3 de marzo de 2017	225.0	225.0	225.0	225.0	225.0
Vencimiento de CDR BCRP del 30 de enero al 3 de febrero de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
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 30 de enero al 3 de febrero 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 interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7,450.0	7,450.0	7,450.0	7,450.0	7,450.0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 3 de febrero de 2017	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de REPO Expansión del 30 de enero al 3 de febrero 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 interés					
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 30 de enero al 3 de febrero de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xii. Subasta de Swaps Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	96.2	96.2	96.2	96.2	96.2
Próximo vencimiento de SC Venta el 6 de febrero de 2017	96.2	96.2	96.2	96.2	96.2
Vencimiento de SC - Venta del 30 de enero al 3 de febrero de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0.0	0.0	3.3	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio			1.0		
ii. Ventas (millones de US\$)			3,273.0		
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	2,249.5	1,212.3	1,886.6	1,370.0	1,178.2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (Inversa)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0137%	0.0138%	0.0138%	0.0137%	0.0127%
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 regularización monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	995.0	99.0	986.0	438.0	280.0
Tipo de cambio promedio	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	1,554.5	1,124.3	1,000.6	912.0	886.2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7,446.9	7,446.9	7,285.9	7,446.9	7,216.1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.5	6.5	6.3	6.5	6.3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,526.5	2,465.4	2,426.0	2,371.8	2,317.0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (†)	2.4	2.2	2.1	2.2	2.0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,392.5	1,185.0	497.5	515.0	600.5
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	4,254,254.25	4,254,254.25	4,254,254.25	4,254,254.25	4,254,254.25
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	135.0	185.0	145.0	141.0	16.0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.75/0.80/0.76	0.75/0.80/0.76	0.75/0.80/0.76	0.65/0.75/0.72	0.65/0.65/0.65
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	20 enero 17	23 enero 17	24 enero 17	25 enero 17	26 enero 17
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	-53.3	-3.0	-32.5	5.2	88.1
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	-96.7	-53.2	-42.0	-56.4	59.9
a. Mercado spot con el público	-119.4	-64.6	-30.7	-78.4	75.7
i. Compras	196.6	161.7	268.3	188.3	300.1
ii. (-) Ventas	316.1	222.6	299.0	264.7	224.4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	162.8	46.2	-18.9	209.0	67.6
i. Pasadas	201.3	187.2	182.2	282.8	366.7
ii. (-) Ventadas	38.4	141.0	141.2	83.8	238.1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	151.8	-4.3	40.2	142.4	38.8
i. Pasadas	178.8	73.8	144.5	214.6	231.5
ii. (-) Ventadas	27.0	78.1	104.3	72.1	192.6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	412.8	254.8	427.2	388.0	444.0
ii. A futuro	3.0	0.0	0.0	12.0	10.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	12.7	-52.5	-25.5	13.3	-54.2
i. Compras	25.9	78.8	101.5	70.9	168.0
ii. (-) Ventas	13.2	127.3	127.0	57.6	222.2
f. Efecto de Opciones	-74.6	-5.2	-5.2	-5.1	-43.5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-1.3	0.9	0.0	-4.9	-7.1
h. Crédito por regularización monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Database)	3.3002	3.2887	3.2815	3.2784	3.3019
(†) Datos preliminares					