

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	13 Marzo 17	14 Marzo 17	15 Marzo 17	16 Marzo 17	17 Marzo 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	4.797,6	4.467,8	3.909,5	3.260,7	2.181,5
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	200,0	200,0	150,0	150,0
Plazo de vencimiento	217,0	510,0	610,0	399,0	546,0
Tasas de Inter. Mínima	185 d	85 d	542 d	184 d	359 d
Máxima	4,43	4,29	4,71	4,43	4,50
Promedio	4,44	4,31	4,75	4,43	4,57
Saldo	27.709,8	27.909,8	28.039,8	28.039,8	28.269,8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 20 de marzo de 2017	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0
Vencimiento de CD BCRP del 20 al 24 de marzo de 2017	400,0	400,0	400,0	400,0	400,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter. Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1.499,0	1.499,0	1.499,0	1.499,0	1.499,0
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 20 al 24 de marzo 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 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 20 al 24 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 20 al 24 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	195,8	1500,0	999,8	712,0	800,0
Plazo de vencimiento	195,8	2615,1	1006,0	1241,5	1.901,9
Tasas de Inter. Mínima	7 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	4,20	3,94	4,00	4,15	3,85
Promedio	4,25	4,01	4,25	4,23	4,12
Saldo	1.959,3	3,96	4,23	3,88	3,97
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 20 de marzo de 2017	1.500,0	1.500,0	1.500,0	1.500,0	1.500,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 20 al 24 de marzo de 2017	1.363,5	1.363,5	1.363,5	1.363,5	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 20 al 24 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 20 al 24 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					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter. Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	150,0	150,0	150,0	150,0	150,0
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 20 al 24 de marzo de 2017	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 20 al 24 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 20 al 24 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 20 al 24 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 20 al 24 de marzo 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	6,5	26,0
ii. Ventas (millones de US\$)				2,0	8,0
iii. Tipo de cambio promedio				3,2450	3,2480
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	2.671,8	2.468,0	2.167,5	1.837,2	1.507,4
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%	0,0138%	0,0139%	0,0129%
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 Overnights en moneda nacional	46,0	380,0	170,0	46,0	193,0
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	2.625,8	2.088,0	1.991,5	1.792,2	1.314,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3.491,7	8.693,7	3.319,4	8.293,7	8.146,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,2	7,2	7,1	7,0	6,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3.359,8	3.290,6	3.204,0	3.123,8	3.017,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,9	2,9	2,7	2,7	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	414,0	489,0	491,0	529,0	608,0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	4.154.254,19	4.104.254,22	4.254.254,25	4.254.254,25	4.254.254,25
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	180,0	184,0	220,0	159,0	160,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,750,75/0,75	0,750,75/0,75	0,750,75/0,75	1,000,100/1,00	1,000,100/1,00
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	0,0	10,0 / 4,43		44,6 / 4,43	20,0 / 4,43
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		30,0 / 4,74	33,0 / 4,57		30,0 / 4,54
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	10 marzo 17	13 marzo 17	14 marzo 17	15 marzo 17	16 marzo 17
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-115,4	-115,4	-115,4	-115,4	-115,4
Flujo de la posición contable = a + b.i - c.i + e + g	13,8	65,8	74,7	-2,2	87,2
a. Mercado spot con el público					
i. Compras	190,9	196,4	273,2	274,3	259,8
ii. (-) Ventas	225,2	138,0	221,0	260,3	218,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-68,7	-120,4	-64,7	65,2	52,7
i. Pactadas	78,1	289,8	161,7	199,8	148,1
ii. (-) Vencidas	166,8	410,2	256,3	134,6	95,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	20,1	85,8	-96,6	27,5	73,7
i. Pactadas	141,4	170,0	39,9	106,3	162,6
ii. (-) Vencidas	121,3	84,2	138,6	78,8	88,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	32,7	392,2	123,4	485,5	408,7
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega					
i. Compras	3,1	-321,3	-89,7	-66,4	41,9
ii. (-) Ventas	104,1	80,8	137,7	61,6	84,9
f. Efecto de Opciones	101,0	402,1	227,4	128,0	43,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-2,5	25,0	-0,9	-18,3	-4,0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	0,1	0,7	-5,6	-5,6	-2,2
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2829	3,2871	3,2859	3,2660	3,2496
11 Datos primarios					