

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**  
(Millones de Soles)

	28 Agosto 17	29 Agosto 17	31 Agosto 17	01 Setiembre 17
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>5 496,1</b>	<b>6 606,1</b>	<b>5 940,8</b>	<b>5 697,3</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>				
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR				
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)				
Propuestas recibidas	30,0	100,0	200,0	299,9
Plazo de vencimiento	138,0	198,0	399,0	526,0
Tasas de Inter Mínima	190 d	99 d	189 d	369 d
Máxima	3,60	3,59	3,62	3,58
Promedio	3,63	3,65	3,65	3,57
Saldo	3,63	3,63	3,64	3,58
Próximo vencimiento de CD BCRP el 07 de septiembre de 2017	26 729,5	27 328,5	28 058,4	28 358,4
Vencimiento de CD BCRP entre el 04 y el 08 de setiembre de 2017	1 015,0	1 015,0	1 015,0	1 015,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	2 460,0	2 460,0	2 460,0	2 460,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 18 de diciembre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 04 y el 08 de setiembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)				
Propuestas recibidas	145,0	145,0	145,0	145,0
Plazo de vencimiento	60 d	60 d	60 d	60 d
Tasas de Inter Mínima	3,61	3,61	3,61	3,61
Máxima	3,70	3,70	3,70	3,70
Promedio	3,66	3,66	3,66	3,66
Saldo	1 095,0	1 095,0	1 095,0	1 095,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 23 octubre, 2017	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de CDLD BCRP entre el 04 y el 08 de setiembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas	2000,0	300,0	2000,0	700,0
Plazo de vencimiento	981,5	821,1	916,2	430,8
Tasas de Inter Mínima	1 d	7 d	1 d	1 d
Máxima	2,80	3,60	2,80	2,80
Promedio	3,49	3,70	3,18	3,75
Saldo	3,07	3,66	3,03	3,13
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 04 de setiembre de 2017	5 450,9	6 638,9	5 764,9	2 000,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 04 y el 08 de setiembre de 2017	4 000,0	5 168,0	5 464,9	2 000,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público				
Propuestas recibidas	5 150,9	6 389,9	5 464,9	2 000,0
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 19 de diciembre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 04 y el 08 de setiembre de 2017	0,0	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
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 04 y el 08 de setiembre de 2017	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	12 533,1	12 533,1	12 533,1	11 833,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 03 de octubre de 2017	700,0	700,0	700,0	20,0
Vencimiento de REPO entre el 04 y el 08 de setiembre de 2017	700,0	700,0	700,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	4 950,0	4 950,0	4 950,0	4 950,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 08 de setiembre de 2017	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 04 y el 08 de setiembre de 2017	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	3 730,0	3 730,0	3 730,0	3 730,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de enero de 2018	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 04 y el 08 de setiembre de 2017	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	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el				
Vencimiento de SC - Venta entre el 04 y el 08 de setiembre de 2017				
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
Próximo vencimiento de SC-Compra				
Vencimiento de SC - Compra entre el 04 y el 08 de setiembre de 2017				
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	1 174,8	0,0	9,7	51,8
i. Compras (millones de US\$)	363,0	0,0	3,0	16,0
ii. Tipo de cambio promedio	3,2363		3,2390	3,2380
ii. Ventas (millones de US\$)				
iii. 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	54,1	54,1	54,1	54,1
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP				
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>2 040,8</b>	<b>819,1</b>	<b>906,6</b>	<b>3 749,1</b>
<b>4. Operaciones más del BCR para el cierre de operaciones</b>				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0109%	0,0116%	0,0109%	0,0119%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	1 245,6	414,0	221,0	67,8
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>795,2</b>	<b>405,1</b>	<b>685,6</b>	<b>3 681,3</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 443,6	6 505,1	6 354,1	6 052,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,3	5,3	5,2	5,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 107,7	2 144,7	1 957,3	3 681,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,7	1,6	7,3
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	533,0	532,0	617,0	1 489,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,60/3,75/3,74	3,30/3,60/3,46	3,50/3,75/3,69	3,75/3,90/3,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	200,0	153,0	19,5	65,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,25/1,25/1,25	1,25/1,30/1,26	1,25/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	209,9	8,6	404,1	404,1
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	109,9 / 3,60	8,6 / 3,63	63,2 / 3,62	63,2 / 3,62
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)				
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>25 agosto 17</b>	<b>28 agosto 17</b>	<b>29 agosto 17</b>	<b>31 agosto 17</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.j + e + f + g	-128,7	3,7	131,1	35,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f + g	-401,9	-236,5	99,3	-10,2
a. Mercado spot con el público	37,1	73,0	83,3	-37,0
i. Compras	316,2	363,0	380,4	302,6
ii. (-) Ventas	279,0	290,0	297,2	339,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	291,7	43,0	149,3	6,6
i. Pactadas	376,5	290,8	244,3	228,7
ii. (-) Vencidas	84,8	207,7	95,0	222,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-1,1	-147,6	116,2	-38,9
i. Pactadas	103,2	52,0	177,1	276,5
ii. (-) Vencidas	104,3	199,5	61,0	315,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	474,9	228,0	474,1	648,1
ii. A futuro	47,0	23,0	242,0	49,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	22,9	95,0	-18,9	123,3
i. Compras	71,6	193,0	57,6	305,9
ii. (-) Ventas	48,7	98,0	76,5	182,6
f. Efecto de Opciones	-19,6	9,6	-1,3	-0,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-442,4	-412,6	0,9	-3,2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Note: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2369	3,2359	3,2407	3,2406
(*) Datos preliminares				