

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

	16 Enero 17	17 Enero 17	18 Enero 17	19 Enero 17	20 Enero 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	6,053.6	5,205.7	4,219.5	3,582.4	3,932.3
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)	30.0	100.0	200.0	30.0	200.0
Propuestas recibidas	140.0	370.0	581.3	175.0	422.0
Plazo de vencimiento	176 d	542 d	85 d	174 d	82 d
Tasas de interés	4.40	4.55	4.30	4.49	4.34
Máxima	4.42	4.75	4.35	4.44	4.35
Promedio	4.40	4.70	4.34	4.49	4.34
Saldo	23,311.0	23,702.0	24,032.1	24,262.1	24,482.1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 09 de febrero de 2017	1,023.2		1,023.2		1,023.2
Vencimiento de CD BCRP del 23 al 27 de enero, 2017	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
Vencimiento de REPO BCRP del 23 al 27 de enero, 2017	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
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 23 al 27 de enero, 2017	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
Vencimiento de CDV BCRP del 23 al 27 de enero, 2017	0.0		0.0		0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	245.0	2876.4	3,300.0	200.0	1600.0
Propuestas recibidas	280.0	2876.4	3,345.9	377.0	1706.6
Plazo de vencimiento	7 d	1 d	1 d	7 d	1 d
Tasas de interés	4.15	3.95	4.00	3.80	4.14
Máxima	4.25	4.25	4.25	4.17	4.22
Promedio	4.20	4.15	4.18	4.15	4.17
Saldo	3,938.3	4,344.9	4,17	2,544.9	4,17
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 23 de enero 2017	3,138.4		1,874.9		2,313.4
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 23 al 27 de enero, 2017	3,938.3		2,174.9		1,827.0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público		-0.9			2,026.9
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
Vencimiento de Coloc-TP del 23 al 27 de enero, 2017	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
Vencimiento de Coloc - BN del 23 al 27 de enero, 2017	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 03 de marzo de 2017	225.0		225.0		225.0
Vencimiento de CDR BCRP del 23 al 27 de enero, 2017	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas		56.0			
Plazo de vencimiento		245.0			
Tasas de interés		730 d			
Máxima		4.81			
Promedio		5.75			
Saldo	13,925.1	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
Vencimiento de REPO del 23 al 27 de enero, 2017	0.0		0.0		0.0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)		150.0			
Propuestas recibidas		425.0			
Plazo de vencimiento		730 d			
Tasas de interés		5.80			
Máxima		5.80			
Promedio		5.80			
Saldo	7,900.0	7,750.0	7,750.0	7,750.0	7,750.0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 23 de Enero de 2017	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de REPO Expansión del 23 al 27 de enero, 2017	300.0		0.0		300.0
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
Vencimiento de REPO Sustitución del 23 al 27 de enero, 2017	0.0		0.0		0.0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	114.0	114.0	114.0	96.2	96.2
Próximo vencimiento de SC Venta el 08 de febrero 2017	100.0		100.0		96.2
Vencimiento de SC - Venta del 23 al 27 de enero, 2017	0.0		0.0		0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR					
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	2,602.2	1,719.7	2,014.5	1,552.4	2,063.8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (Inversa)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0132%	0.0135%	0.0135%	0.0135%	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 regulación 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	996.0	20.0	178.0	281.6	351.4
Tipo 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	1,906.2	1,899.7	1,936.5	1,299.8	1,712.4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7,945.9	7,706.0	7,706.0	7,631.3	7,613.7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.9	6.7	6.7	6.6	6.6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,912.3	2,765.0	2,732.3	2,732.3	2,691.3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (**)	2.5	2.4	2.4	2.3	2.3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	638.0	1,105.0	926.0	996.0	1,145.0
Tasas de interés: 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\$)	33.0	10.5	5.5	17.5	17.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0.60/0.60/0.60	0.65/0.70/0.68	0.70/0.70/0.70	0.70/0.80/0.70	0.70/0.80/0.75
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	110.0	58.5	0.0	115.0	50.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	5.0 / 4.40	23.5 / 4.40		5.0 / 4.30	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	13 enero 17	16 enero 17	17 enero 17	18 enero 17	19 enero 17
Flujo de la posición global = a + b + (-) c + e + f + g	18.3	33.9	-8.8	118.0	-4.1
Flujo de la posición contable = a + b + (-) c + e + f + g	42.0	62.2	-37.7	123.2	-30.0
a. Mercado spot con el público	31.1	59.2	-27.2	25.4	-35.9
i. Compras	652.7	208.2	195.1	213.3	248.5
ii. (-) Ventas	621.6	159.0	167.3	187.9	284.5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	130.3	-18.3	-4.2	-128.4	
i. (-) Ventas	183.7	15.6	15.4	162.9	
ii. Compras forward al público (con y sin entrega)	53.4	33.9	145.6	154.9	
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	154.1	26.2	28.3	41.8	
i. (-) Ventas	187.1	28.6	186.6	146.6	
ii. (-) Ventas	33.0	32.4	158.5	104.9	
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	437.2	184.0	358.8	416.0	449.0
ii. A futuro	34.0	19.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	19.8	26.3	6.6	46.2	56.0
i. Compras	29.5	28.4	19.3	29.9	28.9
ii. (-) Ventas	9.7	1.1	113.7	45.7	231.9
f. Efecto de Opciones	0.1	-0.7	-0.1	-0.1	29.7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-29.3	4.2	-3.2	-0.9	-8.1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Database)	3.3677	3.3690	3.3488	3.3479	3.3339
(*) Datos preliminares					