

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

	30 Enero 17	31 Enero 17	1 Febrero 17	2 Febrero 17	3 Febrero 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3,172.4	3,206.1	3,817.1	3,633.7	4,356.3
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)	30.0 115.0 185.4 4.45 4.49 4.48	200.0 284.0 31.6 4.24 4.27 4.25	100.0 100.0 30.4 4.26 4.29 4.27	30.0 98.0 369.4 4.78 4.82 4.61	30.0 142.0 369.4 4.53 4.52 4.61
Saldo	25,482.1	25,582.1	25,512.1	25,642.1	25,842.1
Próximo 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 6 al 10 de febrero de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	399.0	600.0	600.0	300.0	300.0
Plazo de vencimiento	1,199.0	1,199.0	1,199.0	650.0	650.0
Tasas de interés Mínima	1.0	1.0	1.0	1.0	1.0
Máxima	4.45	4.45	4.45	4.45	4.45
Promedio	4.28	4.28	4.28	4.28	4.28
Saldo	1,199.0	1,199.0	1,199.0	1,499.0	1,699.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 06 de febrero de 2017	399.0	600.0	600.0	300.0	300.0
Vencimiento de Repo BCRP del 6 al 10 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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Plazo de vencimiento	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés Mínima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Máxima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 6 al 10 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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Plazo de vencimiento	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés Mínima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Máxima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 10 de febrero de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de CDV BCRP del 6 al 10 de febrero de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	1,335.8	1,346.8	1,346.8	1,346.8	1,346.8
Propuestas recibidas	1,335.8	1,346.8	1,346.8	1,346.8	1,346.8
Plazo de vencimiento	1.0	1.0	1.0	1.0	1.0
Tasas de interés Mínima	4.15	4.15	4.15	4.15	4.15
Máxima	4.25	4.25	4.25	4.25	4.25
Promedio	4.21	4.22	4.22	4.22	4.22
Saldo	1,792.3	1,803.3	1,803.3	200.0	0.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 2 de febrero de 2017	1,335.8	1,346.8	1,346.8	200.0	0.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 6 al 10 de febrero de 2017	1,792.5	1,803.3	1,803.3	200.0	0.0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas	1,600.0	1,600.0	1,600.0	1,600.0	1,600.0
Plazo de vencimiento	300.1	300.1	300.1	300.1	300.1
Tasas de interés Mínima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Máxima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 6 al 10 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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Plazo de vencimiento	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés Mínima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Máxima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 10 de febrero de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Coloc - BN del 6 al 10 de febrero de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reaustables del BCRP (ICDR BCRP)					
Propuestas recibidas	225.0	225.0	225.0	225.0	225.0
Plazo de vencimiento	225.0	225.0	225.0	225.0	225.0
Tasas de interés Mínima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Máxima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 6 al 10 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	13,980.1	13,980.1	13,980.1	13,980.1	13,980.1
Plazo de vencimiento	400.0	400.0	400.0	400.0	400.0
Tasas de interés Mínima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Máxima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 6 al 10 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	7,450.0	7,450.0	7,450.0	7,450.0	7,150.0
Plazo de vencimiento	300.0	300.0	300.0	300.0	500.0
Tasas de interés Mínima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Máxima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Saldo	7,450.0	7,450.0	7,450.0	7,450.0	7,150.0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 3 de febrero de 2017	300.0	300.0	300.0	300.0	500.0
Vencimiento de Repo Expansión del 6 al 10 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	4,804.7	4,804.7	4,804.7	4,804.7	4,804.7
Plazo de vencimiento	243.0	243.0	243.0	243.0	243.0
Tasas de interés Mínima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Máxima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 6 al 10 de febrero de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xii. Subasta de Swaps Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	96.2	96.2	96.2	96.2	96.2
Plazo de vencimiento	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés Mínima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Máxima	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 6 al 10 de febrero de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neocación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	311.7	96.0
- Tipo de cambio promedio				3.2470	
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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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	1,606.6	1,799.3	3,787.1	4,215.4	3,896.3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (Inversa)	0.0137%	0.0138%	0.0138%	0.0139%	0.0129%
Comisión (tasa efectiva diaria)					
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 regularización monetaria en moneda nacional	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
Tasa de interés					
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1,196.6	1,263.3	3,753.9	4,156.9	3,776.7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7,097.7	7,446.8	8,885.6	7,446.8	8,645.5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.2	6.5	7.9	6.5	7.5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,163.7	2,136.5	3,753.9	3,753.9	3,761.5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (**)	1.9	2.2	3.4	2.2	3.3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	432.0	245.5	695.5	693.5	781.5
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\$)	110.0	70.5	110.0	48.0	50.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0.70/0.75/0.73	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	0.0	0.0	30.0	80.0	125.9
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				80.0 / 4.60	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	27 enero 17	30 enero 17	31 enero 17	01 febrero 17	02 febrero 17
Flujo de la posición alfab. = a + b + (-) c + e + f + g	-15.8	43.5	22.2	-112.1	-42.6
Flujo de la posición contable = a + b + (-) c + e + f + g	-77.4	109.3	-21.7	-114.2	-163.3
a. Mercado spot con el público	-88.1	75.2	-20.4	-115.2	-65.7
i. Compras	212.4	326.5	252.2	132.6	197.3
ii. (-) Ventas	310.5	251.3	272.8	247.8	264.1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	73.1	31.7	94.4	-17.7	57.2
i. Pasivas	211.6	165.7	156.4	71.6	156.1
ii. (-) Ventas	148.5	134.0	162.0	89.3	99.0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	0.6	97.5	49.8	-19.6	-69.8
i. Pasivas	184.3	137.7	137.7	175.7	107.3
ii. (-) Ventas	183.7	40.2	117.2	195.2	177.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	280.5	344.7	390.4	272.0	445.4
ii. A futuro	6.0	13.0	5.0	0.0	0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	62.6	-52.7	26.7	105.6	79.1
i. Compras	179.3	217.8	117.8	192.0	175.2
ii. (-) Ventas	116.7	74.4	88.1	86.4	97.0
f. Efecto de Opciones	-14.8	-14.0	0.3	21.9	21.9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-6.8	-7.0	-13.0	1.3	-125.7
h. Crédito por regularización monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Database)	3.2894	3.2883	3.2830	3.2701	3.2541
(*) Datos preliminares					