

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

	6 Febrero 17	7 Febrero 17	8 Febrero 17	9 Febrero 17	10 Febrero 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	4,086.0	4,995.6	5,095.9	5,253.1	6,754.3
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)					
Propuestas recibidas	30.0	100.0	30.0	200.0	200.0
Plazo de vencimiento	76.0	412.0	70.0	395.0	300.0
Tasas de interés	178.4	28.4	547.6	28.4	84.4
Tasas de interés Mínima	4.48	4.21	4.23	4.23	4.24
Tasas de interés Máxima	4.49	4.27	4.27	4.28	4.49
Plazo de vencimiento Promedio	4.49	4.24	4.26	4.26	4.24
Saldo	25,672.1	25,772.1	26,002.1	25,408.9	26,008.9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de febrero de 2017	1,023.2		1,023.2		849.9
Vencimiento de CD BCRP entre el 13 y el 17 de febrero de 2017	0.0		0.0		0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Tasas de interés Máxima					
Plazo de vencimiento 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
Vencimiento de REPO BCRP entre el 13 y el 17 de febrero de 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 Mínima					
Tasas de interés Máxima					
Plazo de vencimiento 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 entre el 13 y el 17 de febrero de 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 Mínima					
Tasas de interés Máxima					
Plazo de vencimiento 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 entre el 13 y el 17 de febrero de 2017	0.0		0.0		0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas		100.0	299.9	800.0	1,300.1
Plazo de vencimiento		422.0	766.0	1,107.0	2,038.9
Tasas de interés		7.4	7.4	7.4	7.4
Tasas de interés Mínima		4.14	4.14	3.50	3.90
Tasas de interés Máxima		4.20	4.20	4.19	4.20
Plazo de vencimiento Promedio		4.17	4.18	4.05	4.18
Saldo	0.0	300.0	1,199.9	1,699.9	3,199.9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 13 de febrero de 2017	0.0		800.0		2,500.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 13 y el 17 de febrero de 2017	0.0		0.0		2,899.9
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Tasas de interés Máxima					
Plazo de vencimiento 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 entre el 13 y el 17 de febrero de 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 Mínima					
Tasas de interés Máxima					
Plazo de vencimiento 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 entre el 13 y el 17 de febrero de 2017	0.0		0.0		0.0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Tasas de interés Máxima					
Plazo de vencimiento 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
Vencimiento de CDR BCRP entre el 13 y el 17 de febrero de 2017	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Tasas de interés Máxima					
Plazo de vencimiento 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
Vencimiento de REPO entre el 13 y el 17 de febrero de 2017	0.0		0.0		0.0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Tasas de interés Máxima					
Plazo de vencimiento Promedio					
Saldo	7,150.0	7,150.0	7,150.0	7,150.0	7,150.0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de febrero de 2017	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 13 y el 17 de febrero de 2017	0.0		0.0		0.0
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Tasas de interés Máxima					
Plazo de vencimiento 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 entre el 13 y el 17 de febrero de 2017	0.0		0.0		0.0
xii. Subasta de Swaps Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Tasas de interés Máxima					
Plazo de vencimiento Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de SC - Venta entre el 13 y el 17 de febrero de 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	4,096.0	4,995.6	3,766.0	3,523.0	3,360.8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (Inversa)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0129%	0.0129%	0.0129%	0.0129%	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 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	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	3,925.0	4,596.1	3,749.0	2,823.0	3,069.8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8,772.5	8,772.5	8,740.9	8,731.1	8,742.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (1)	7.7	7.8	7.6	7.6	7.7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,890.8	3,861.0	3,847.0	3,927.8	3,841.9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (1)	3.4	3.5	3.4	3.4	3.4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	724.0	633.0	554.0	553.0	749.0
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	89.0	141.0	168.0	102.0	258.0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.75/0.75/0.75	0.75/0.75/0.75	0.75/0.75/0.75	0.75/0.75/0.75	0.75/0.75/0.75
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	41.3	0.0	91.3	91.3	273.5
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					32,544.60
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	03 febrero 17	06 febrero 17	07 febrero 17	08 febrero 17	09 febrero 17
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	-63.1	75.5	-78.3	16.0	40.1
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	-78.2	123.0	-252.3	-7.0	-76.3
a. Mercado spot con el público	-78.4	128.2	-252.2	-0.9	-65.0
i. Compras	257.0	286.6	286.6	184.2	227.1
ii. (-) Ventas	335.3	157.4	312.1	195.1	273.1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	139.7	4.9	113.9	48.6	-43.2
i. (-) Ventas	159.7	87.6	440.8	158.4	282.5
ii. Compras forward al público (con y sin entrega)	10.9	62.7	326.7	108.7	245.7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	132.4	42.2	-99.3	29.1	-188.5
i. (-) Ventas	184.2	151.2	114.0	110.1	75.8
ii. Compras	51.8	108.9	173.4	81.1	284.3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	360.0	394.2	461.2	343.0	432.0
ii. A futuro	11.0	10.0	11.0	5.0	6.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	40.1	11.3	-153.3	-18.0	-9.0
i. Compras	44.2	89.2	171.7	79.5	285.9
ii. (-) Ventas	4.1	78.0	325.0	97.5	237.9
f. Efecto de Opciones	7.8	6.2	2.4	2.4	-29.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-1.1	9.7	2.8	-5.8	-2.7
h. Crédito por regularización monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Databe)	3.2465	3.2777	3.2929	3.2878	3.2719
(1) Datos preliminares					