

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	20 Marzo 17	21 Marzo 17	22 Marzo 17	23 Marzo 17	24 Marzo 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1.866,9	1.335,9	1.243,4	1.722,6	2.331,9
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	30,0	99,9
Plazo de vencimiento	100,0	228,0	152,5	70,5	336,0
Tasas de Inter. Mínima	178 d	353 d	533 d	364 d	31 d
Máxima	4,42	4,53	4,71	4,55	4,21
Promedio	4,43	4,64	4,71	4,60	4,26
Saldo	28.399,8	28.299,8	28.229,8	28.159,8	28.259,7
Vencimiento de CD BCRP del 27 al 31 de marzo de 2017	100,0		100,0		150,0
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
Vencimiento de Repo de Valores el 08 de mayo de 2017	399,0		400,0		399,0
Vencimiento de REPO BCRP del 27 al 31 de marzo 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 Inter. Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 27 al 31 de marzo 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 Inter. Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDV BCRP el 27 al 31 de marzo de 2017	0,0		0,0		0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	100,1	300,0	149,8	500,0	1.100,0
Plazo de vencimiento	208,5	619,5	272,0	873,0	1.786,8
Tasas de Inter. Mínima	7 d	1 d	7 d	1 d	3 d
Máxima	3,35	3,10	4,10	3,80	3,60
Promedio	4,22	3,90	4,10	3,99	3,79
Saldo	4,14	3,82	4,10	3,84	3,73
Vencimiento de Depósitos a Plazo el 27 de marzo de 2017	400,1	249,9	249,9	749,9	1.349,9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 27 al 31 de marzo de 2017	300,0		100,1		1.200,1
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
Vencimiento de Coloc-TP el 08 de junio de 2017	300,1		300,1		300,1
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
Vencimiento de Coloc-BN el 08 de junio de 2017	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
Vencimiento de CDR BCRP el 03 de mayo de 2017	150,0		150,0		150,0
vencimiento de CDR BCRP del 27 al 31 de marzo de 2017	0,0		0,0		0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reular)					
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
Vencimiento de REPO del 27 al 31 de marzo de 2017	400,0		400,0		400,0
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
Vencimiento de REPO Expansión del 27 al 31 de marzo de 2017	400,0		400,0		400,0
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
Vencimiento de REPO Sustitución del 27 al 31 de marzo de 2017	243,0		243,0		243,0
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
Vencimiento de SC - Venta el 27 al 31 de marzo de 2017	0,0		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neoposición del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	129,9	0,0	463,8	444,6	679,0
ii. Ventas (millones de US\$)	40,0		143,0	137,0	203,5
iii. Tipo de cambio promedio	3,2475		3,2437	3,2449	3,2412
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	1.466,7	1.186,1	2.077,2	1.637,2	1.711,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
i. Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0139%	0,0139%	0,0139%	0,0139%	0,0129%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	140,0	235,0	480,0	296,0	885,0
Tasa de interés	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
d. Depósitos Overnights 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	1.326,7	951,1	1.597,2	1.341,2	1.026,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7.591,5	7.697,5	7.703,7	7.647,0	7.531,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,7	6,5	6,6	6,5	6,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2.622,5	2.695,9	2.646,0	2.589,3	2.524,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,3	2,2	2,3	2,2	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	933,0	1.140,0	1.404,0	975,0	468,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	4.254/3.014/2,5	4.254/2.514/2,5	4.254/2.514/2,5	4.254/2.514/2,5	4.254/2.514/2,5
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	17,8	5,0	5,0	
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio		1,0/1,0/1,0	1,0/1,0/1,0	1,0/1,0/1,0	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	66,3	35,0	0,0	0,0	12,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	16,9 / 4,43				12,0 / 4,40
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	17 marzo 17	20 marzo 17	21 marzo 17	22 marzo 17	23 marzo 17
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	23,4	42,4	-8,3	-18,7	20,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g + q	73,7	87,2	79,2	-0,6	-40,3
a. Mercado spot con el público	74,5	123,4	80,3	146,6	105,0
i. Compras	290,2	255,8	245,0	381,4	329,9
ii. (-) Ventas	215,7	132,4	164,7	234,8	224,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-29,1	12,3	-97,2	-85,8	-46,4
i. Pactadas	79,2	65,3	68,7	77,2	71,8
ii. (-) Vencidas	108,3	53,0	165,9	162,9	118,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-18,9	59,5	-45,5	-77,3	1,3
i. Pactadas	220,2	234,1	185,3	131,9	105,8
ii. (-) Vencidas	239,1	174,6	231,7	209,2	104,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	435,0	297,2	374,2	536,5	547,7
ii. A futuro	9,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	136,7	126,3	66,6	47,5	-14,7
i. Compras	234,3	170,5	223,9	208,2	101,7
ii. (-) Ventas	97,6	44,2	157,3	160,7	116,5
f. Efecto de Opciones	-1,1	2,3	-0,1	-8,7	6,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-6,8	-40,8	-1,9	-148,3	-144,2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2496	3,2488	3,2461	3,2482	3,2445
11. Datos primarios					