

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

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

	3 Julio 17	4 Julio 17	5 Julio 17	6 Julio 17	7 Julio 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 571,8	2 543,5	2 028,3	2 635,4	1 799,9
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		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	92,0		66,0	164,0	
Tasas de interés Mínima	185 d		554 d	371 d	
Máxima	3,76		3,78	3,60	
Promedio	3,76		3,90	3,78	
Saldo	26 813,3	26 813,3	26 843,3	25 383,1	25 383,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de julio de 2017	1 490,2	1 490,2	1 490,2	660,1	660,0
Vencimiento de CD BCRP del 07 al 14 de julio de 2017	1 490,2	1 490,2	1 490,2	660,1	660,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	200,0	500,0	1 025,0		
Plazo de vencimiento	315,0	1 090,0	1 025,0	970,0	850,0
Tasas de interés Mínima	1099 d	7 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	4,30	4,15	4,00	4,00	4,00
Promedio	4,51	4,25	4,08	4,01	4,05
Saldo	4,39	5 635,0	4,00	4,00	4,03
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 10 de julio de 2017		1 025,0	1 570,0	4 310,0	4 760,0
Vencimiento de REPO BCRP del 07 al 14 de julio de 2017		1 025,0	1 570,0	1 610,0	1 350,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dolares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el					
Vencimiento de CDLD BCRP del 07 al 14 de julio de 2017					
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 07 al 14 de julio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 600,0	1 600,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 5 de julio de 2017	500,0	500,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de Coloc-TP del 07 al 14 de julio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Requeables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP					
Vencimiento de CDR BCRP del 07 al 14 de julio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas	308,0	308,0	308,0	308,0	308,0
Plazo de vencimiento	730 d				
Tasas de interés Mínima	4,14	4,14	4,14	4,14	4,14
Máxima	4,14	4,14	4,14	4,14	4,14
Promedio	4,14	4,14	4,14	4,14	4,14
Saldo	12 783,1	12 783,1	12 783,1	12 783,1	12 783,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 25 de Agosto de 2017	250,0	250,0	250,0	250,0	250,0
Vencimiento de REPO del 07 al 14 de julio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 750,0	5 750,0	5 750,0	5 750,0	4 950,0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 08 de setiembre de 2017	800,0	800,0	800,0	800,0	600,0
Vencimiento de REPO Expansion del 07 al 14 de julio de 2017	0,0	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 interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 730,0	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	200,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 07 al 14 de julio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	293,0	293,0	293,0	293,0	293,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 julio 2017	243,0	243,0	243,0	243,0	243,0
Vencimiento de SC - Venta del 07 al 14 de julio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra					
Vencimiento de SC - Compra del 07 al 14 de julio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	3 566,8	3 513,5	3 108,3	3 305,4	2 849,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0139%	0,0139%	0,0138%	0,0139%	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 regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	10,0	40,0	10,0	11,1	46,1
Tasa de interés	2,75%	2,75%	2,75%	2,75%	2,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 556,8	3 473,5	3 098,3	3 294,3	2 803,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 445,3	6 635,7	6 595,2	6 658,6	6 639,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,7	5,5	5,5	5,7	5,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 123,0	2 359,2	2 318,0	2 599,5	2 618,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,9	2,0	1,9	2,2	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	899,5	915,0	925,0	970,5	1 225,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	54,0	50,0	50,0	24,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,25/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP: CDBCRP-NR y CDV	150,0	5,1	121,4	157,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	25,0 / 3,76				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)	21,5 / 3,79				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	30 Julio 17	03 Julio 17	04 Julio 17	05 Julio 17	06 Julio 17
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	14,0	-86,0	-8,3	67,0	-51,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	17,1	-32,0	-33,8	52,8	-22,3
a. Mercado spot con el público.	44,5	-130,9	-34,2	-47,3	-47,9
i. Compras	116,6	301,0	188,5	230,8	290,3
ii. (-) Ventas	181,1	431,8	222,7	278,1	338,2
iii. Compras toward al público (con y sin entrega)	-15,9	-64,9	-18,5	-4,0	-4,0
i. Pacladas	79,0	164,1	70,1	170,3	121,7
ii. (-) Vendidas	85,0	208,8	5,2	188,7	125,7
c. Ventas toward al público (con y sin entrega)	-2,1	46,2	40,6	-31,3	26,2
i. Pacladas	1,2	80,2	46,3	104,6	393,5
ii. (-) Vendidas	3,4	34,0	5,7	135,9	367,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	0,0	394,1	184,3	327,4	558,0
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	94,3	20,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	0,0	-74,6	5,1	46,0	268,8
i. Compras	0,1	25,5	5,1	134,6	366,1
ii. (-) Ventas	0,1	100,1	0,0	88,6	97,3
f. Efecto de Opciones	0,7	2,8	0,2	1,4	1,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	62,7	-4,2	1,2	-1,7
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2522	3,2521	3,2569	3,2622	3,2557
(*) Datos preliminares					