

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	10 Julio 17	11 Julio 17	12 Julio 17	13 Julio 17	14 Julio 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 771,0	2 402,8	2 624,0	3 767,9	3 272,4
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	126,0		113,4	140,0	
Tasas de inter Mínima	178,4		547,4	364,4	
Máxima	3,72		3,73	3,55	
Promedio	3,74		3,75	3,73	
Saldo	3,73		3,76	3,71	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 03 de agosto de 2017	25 413,1	24 753,0	24 783,0	23 583,0	23 583,0
Vencimiento de CD BCRP del 17 al 21 de julio de 2017	660,0	1 230,0	1 230,0	260,0	260,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1 000,0				
Plazo de vencimiento	1 255,0				
Tasas de inter Mínima	1,0				
Máxima	4,00				
Promedio	4,05				
Saldo	4,04				
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 03 de agosto de 2017	4 110,0	2 910,0	2 910,0	2 910,0	2 760,0
Vencimiento de REPO BCRP del 17 al 21 de julio de 2017	1 200,0	150,0	150,0	150,0	300,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas	1 350,0	150,0	150,0	150,0	0,0
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el					
Vencimiento de CDLD BCRP del 17 al 21 de julio de 2017				1 100,5	556,5
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas				1 103,6	557,5
Plazo de vencimiento				1,0	3,0
Tasas de inter Mínima				3,00	3,20
Máxima				4,00	3,75
Promedio				3,70	3,59
Saldo	0,0	0,0	0,0	1 100,5	556,5
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de julio de 2017	0,0	0,0	0,0	1 100,5	556,5
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 17 al 21 de julio de 2017	0,0	0,0	0,0	1 100,5	556,5
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 19 de diciembre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de Coloc-TP del 17 al 21 de julio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 17 al 21 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					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
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 17 al 21 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 inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 950,0	4 950,0	4 950,0	4 950,0	4 950,0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 08 de setiembre de 2017	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de REPO Expansion del 17 al 21 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 inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 730,0	3 730,0	3 730,0	3 730,0	3 730,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 26 de enero de 2018	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO Sustitucion del 17 al 21 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 inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	50,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el	50,0				
Vencimiento de SC - Venta del 17 al 21 de julio de 2017	50,0				
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 17 al 21 de julio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación 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	0,0	0,0	0,0	0,0	54,1
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2 741,0	2 402,8	2 594,0	2 637,4	2 715,9
4. Operaciones más el BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0139%	0,0139%	0,0139%	0,0139%	0,0119%
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	10,0	203,9	162,0	21,8	345,0
Depósitos Overnight en moneda nacional	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	2 731,0	2 198,9	2 432,0	2 615,6	2 370,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	7 004,5	6 920,1	6 986,6	6 938,9	6 912,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,8	5,7	5,8	5,8	5,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 727,9	2 672,5	2 712,2	2 683,1	2 646,2
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	1 293,0	1 332,0	1 116,0	1 384,0	1 222,5
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	3,75/3,75/3,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,00
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				1,25/1,25/1,25	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	142,3	0,0	900,0	0,0	54,1
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)			900,0 / 3,75		
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	07 julio 17	10 julio 17	11 julio 17	12 julio 17	13 julio 17
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	6,9	-56,7	40,1	-80,4	34,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	56,4	-78,4	-23,7	-44,3	58,7
a. Mercado spot con el público:	28,8	-165,2	-29,0	-76,7	12,0
i. Compras	340,6	194,9	281,7	226,1	317,5
ii. (-) Ventas	313,8	360,1	310,7	302,8	305,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	66,9	61,2	6,2	-3,9	13,6
i. Pactadas	132,2	284,2	133,6	138,2	181,1
ii. (-) Vencidas	65,3	263,0	127,4	142,1	167,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	128,2	-84,1	-82,9	12,3	32,9
i. Pactadas	266,1	69,1	64,9	123,8	183,0
ii. (-) Vencidas	139,9	153,3	147,8	111,5	150,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	467,7	404,9	392,7	410,7	541,8
ii. A futuro	20,0	40,0	35,9	9,0	60,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	112,6	-29,3	24,9	1,8	35,7
i. Compras	137,2	150,8	145,8	111,4	145,6
ii. (-) Ventas	24,6	180,1	120,9	109,6	109,9
f. Efecto de Opciones	9,8	-10,1	-10,1	0,1	-4,5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-8,4	-67,5	-14,5	0,1	-6,4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2507	3,2556	3,2543	3,2513	3,2496
(*) Datos preliminares					