

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

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

	17 Julio 17	18 Julio 17	19 Julio 17	20 Julio 17	21 Julio 17
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>3 127,3</b>	<b>2 995,8</b>	<b>2 547,1</b>	<b>2 706,4</b>	<b>-508,8</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
<b>a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR</b>					
<b>i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)</b>					
Propuestas recibidas	30,0		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	191,0		155,4	147,3	
Tasas de interés	3,58		3,72	3,64	
Máxima	3,73		3,72	3,64	
Promedio	3,68		3,72	3,64	
Saldo	23 613,0	23 613,0	23 643,0	23 673,0	23 673,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 03 de agosto de 2017	260,0		260,0		260,0
Vencimiento de CD BCRP del 24 al 26 de julio de 2017	0,0		0,0		0,0
<b>ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)</b>					
Propuestas recibidas					1000,0
Plazo de vencimiento					1985,0
Tasas de interés					3 d
Máxima					3,82
Promedio					4,15
Saldo	2 760,0	2 760,0	2 760,0	2 760,0	4 960,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 24 de julio de 2017	300,0		300,0		2 200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 24 al 26 de julio de 2017	0,0		0,0		2 200,0
<b>iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el					
Vencimiento de CDLD BCRP del 24 al 26 de julio de 2017					
<b>iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</b>					
Propuestas recibidas	1 200,0	1 000,0	539,6	1 216,0	
Plazo de vencimiento	1 510,0	1 522,0	539,6	1 216,0	
Tasas de interés	1 d	1 d	1 d	1 d	
Máxima	3,65	2,60	3,45	3,50	
Promedio	3,75	3,70	3,75	3,75	
Saldo	1 200,0	1 000,0	539,6	1 216,0	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 21 de julio de 2017	1 200,0		539,6		
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 24 al 26 de julio de 2017	1 200,0		539,6		
<b>v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
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
Vencimiento de Coloc-TP del 24 al 26 de julio de 2017	0,0		0,0		0,0
<b>vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 24 al 26 de julio de 2017	0,0		0,0		0,0
<b>vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
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
Vencimiento de REPO del 24 al 26 de julio de 2017	0,0		0,0		0,0
<b>viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 950,0	4 950,0	4 950,0	4 950,0	4 950,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 08 de setiembre de 2017	600,0		600,0		600,0
Vencimiento de REPO Expansión del 24 al 26 de julio de 2017	0,0		0,0		0,0
<b>ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
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
Vencimiento de REPO Sustitución del 24 al 26 de julio de 2017	0,0		0,0		0,0
<b>x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el					
Vencimiento de SC - Venta del 24 al 26 de julio de 2017					
<b>xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de SC - Compra del 24 al 26 de julio de 2017	0,0		0,0		0,0
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</b>	0,0	32,4	797,3	978,8	0,0
<b>i. Compras (millones de US\$)</b>					
Tipo de cambio promedio		10,0	246,0		
ii. Ventas (millones de US\$)		3,2420	3,2412		
<b>c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</b>					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
<b>d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</b>					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	54,1	54,1	54,1	54,1	54,1
ii. Compras de BTP					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>1 897,3</b>	<b>2 028,2</b>	<b>2 774,9</b>	<b>2 439,1</b>	<b>1 691,2</b>
<b>4. Operaciones netas del BCR para el cierre de operaciones</b>					
<b>a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</b>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0108%	0,0108%	0,0108%	0,0109%	0,0119%
<b>b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</b>					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
<b>c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</b>					
Tasa de interés	50,3	72,6	731,8	750,8	426,4
Depósitos Overnight en moneda nacional	2,75%	2,75%	2,75%	2,75%	2,75%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>1 847,0</b>	<b>1 955,6</b>	<b>2 043,1</b>	<b>1 888,3</b>	<b>1 284,8</b>
<b>a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)</b>	6 850,1	6 855,5	6 855,9	6 855,9	6 872,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,7	5,7	5,7	5,7	5,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 580,9	2 604,3	2 574,8	2 504,3	2 385,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,1	2,2	2,1	2,1	2,0
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
<b>a. Operaciones a la vista en moneda nacional</b>	1 608,0	1 801,0	1 250,0	1 489,0	1 804,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,75/3,75/3,75	3,75/3,75/3,75	3,75/3,75/3,75	3,75/3,75/3,75	3,75/3,75/3,75
<b>b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</b>	0,0	0,0	49,5	36,0	36,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio			1,00/1,25/1,22	1,00/1,25/1,22	1,20/1,25/1,25
<b>c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</b>	20,0	613,6	999,3	418,7	0,9
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	10,0 / 3,70	149,3 / 3,75	149,3 / 3,75	10,0 / 3,72	
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>14 julio 17</b>	<b>17 julio 17</b>	<b>18 julio 17</b>	<b>19 julio 17</b>	<b>20 julio 17</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-132,6	204,0	-183,3	60,2	-126,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-20,1	196,2	52,7	-52,8	-183,6
<b>a. Mercado spot con el público</b>					
i. Compras	298,1	51,0	-15,9	146,9	48,6
ii. (-) Ventas	489,8	333,8	261,3	302,0	289,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)					
i. Pactadas	38,4	-84,4	-155,6	90,7	-18,0
ii. (-) Vencidas	365,4	302,0	101,2	188,5	179,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)					
i. Pactadas	348,3	263,5	263,9	97,8	195,1
ii. (-) Vencidas	130,9	33,1	69,3	-21,9	-51,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. (-) Ventas	241,5	208,5	208,7	47,6	340,4
ii. Compras	110,6	247,4	140,4	69,5	421,7
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega					
i. Al contado	358,3	518,4	713,5	430,0	488,0
ii. A futuro	28,0	14,0	8,0	20,0	20,0
f. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-69,0	127,3	-31,0	17,6	285,7
g. Compras	66,4	243,8	127,5	67,4	405,3
h. (-) Ventas	135,4	116,5	158,5	49,8	119,5
i. Efecto de Opciones	1,3	1,5	-11,9	0,4	1,6
ii. Compras	2,8	2,8	-17,0	-245,6	-301,5
iii. (-) Ventas					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2439	3,2495	3,2446	3,2413	3,2401
(*) Datos preliminares					