

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU			
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS			
(Millones de Soles)			
	24 Julio 17	25 Julio 17	26 Julio 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	90,0	-587,1	162,8
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
Plazo de vencimiento	194,5		112,0
Tasas de inter	178 d		533 d
Mínima	3,60		3,65
Máxima	3,63		3,70
Promedio	3,63		3,70
Saldo	23 703,0	23 703,0	23 733,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 03 de agosto de 2017	260,0		260,0
Vencimiento de CD BCRP el 31 de julio y el 04 de agosto de 2017	0,0		260,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			
Propuestas recibidas	800,0	750,0	500,0
Plazo de vencimiento	2090,0	958,0	500,0
Tasas de inter	1 d	1 d	1 d
Mínima	3,86	3,88	4,15
Máxima	4,11	4,12	4,17
Promedio	4,09	4,01	4,15
Saldo	4 310,0	3 760,0	800,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 31 de julio de 2017	1 550,0		800,0
Vencimiento de REPO BCRP el 31 de julio y el 04 de agosto de 2017	1 550,0		2 800,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dolares del BCRP (CDLD BCRP)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de inter			
Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo			
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el			
Vencimiento de CDLD BCRP el 31 de julio y el 04 de agosto de 2017			
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de inter			
Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo			
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 21 de julio de 2017			
Vencimiento de Depósitos a Plazo el 31 de julio y el 04 de agosto de 2017			
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público			
Propuestas recibidas	500,0	400,0	400,0
Plazo de vencimiento	1 478,4	1 161,7	1 161,7
Tasas de inter	385 d	385 d	385 d
Mínima	4,36	4,36	4,36
Máxima	5,12	4,55	4,55
Promedio	4,53	4,41	4,41
Saldo	1 600,0	2 000,0	2 000,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 19 de diciembre de 2017	200,0		200,0
Vencimiento de Coloc-TP el 31 de julio y el 04 de agosto de 2017	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
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0		0,0
Vencimiento de CDR BCRP el 31 de julio y el 04 de agosto de 2017	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
Próximo vencimiento de Repo Regular el 25 de Agosto de 2017	250,0		250,0
Vencimiento de REPO el 31 de julio y el 04 de agosto de 2017	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
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 08 de setiembre de 2017	600,0		600,0
Vencimiento de REPO Expansion el 31 de julio y el 04 de agosto de 2017	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
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de enero de 2018	200,0		200,0
Vencimiento de REPO Sustitución el 31 de julio y el 04 de agosto de 2017	0,0		0,0
x. 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
Próximo vencimiento de SC-Venta el			
Vencimiento de SC - Venta el 31 de julio y el 04 de agosto de 2017			
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
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0		0,0
Vencimiento de SC - Compra el 31 de julio y el 04 de agosto de 2017	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	54,1	54,1	54,1
ii. Compras de BTP			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 110,0	992,9	2 132,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0108%	0,0108%	0,0114%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	4,80%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés			
d. Depósitos Oversight en moneda nacional	126,2	46,1	1 313,6
Tasa de interés	2,75%	2,75%	2,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	983,8	946,8	819,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) ^(*)	6 691,1	6 553,0	6 503,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) ^(*)	5,5	5,4	5,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 393,1	2 348,1	2 289,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) ^(*)	2,0	2,0	1,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 575,0	2 276,0	999,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,75/3,75/3,75	3,75/3,90/3,80	3,75/4,00/3,79
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	37,5	0,0	10,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,25/1,25/1,25		1,25/1,25/1,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP - CDBCRP-NR y CDV	337,2	428,5	101,3
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	205,0 / 3,75	205,0 / 3,75	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)			
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	21 Julio 17	24 Julio 17	25 Julio 17
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	133,4	-39,3	-39,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	103,1	73,3	103,0
a. Mercado spot con el público	113,5	-118,6	3,7
i. Compras	355,3	250,6	267,7
(i) Ventas	241,8	367,0	264,0
ii. Ventas	24,3	-161,6	-59,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	65,6	226,6	176,1
i. Pactadas	31,3	388,3	236,4
ii. Ventas	0,5	-47,2	-19,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	131,8	194,3	339,9
i. Pactadas	131,2	241,5	359,5
ii. Ventas			
d. Operaciones cambiarias interbancarias	376,0	385,4	793,3
i. Al contado	22,0	3,0	13,0
ii. A futuro	89,9	41,7	222,7
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	103,6	236,5	349,9
i. Compras	13,7	194,8	127,2
ii. Ventas	-3,5	1,9	-7,1
f. Efecto de Opciones	-0,4	1,2	0,7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras			
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2473	3,2463	3,2476
(*) Datos preliminares			