

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

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

	31 Julio 17	01 Agosto 17	02 Agosto 17	03 Agosto 17	04 Agosto 17
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>1 634,5</b>	<b>2 915,6</b>	<b>2 242,6</b>	<b>2 701,1</b>	<b>2 752,9</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	132,0		167,0	232,0	
Tasas de inter Mínima	190 d		554 d	371 d	
Máxima	3,59		3,66	3,60	
Promedio	3,61		3,68	3,62	
Saldo	23 763,0	23 763,0	23 793,0	23 563,0	23 563,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de agosto de 2017	260,0	260,0	1 190,0	1 190,0	1 190,0
Vencimiento de CD BCRP del 07 al 11 de agosto de 2017	260,0	260,0	260,0	0,0	0,0
<b>ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)</b>					
Propuestas recibidas		1 525,0	1 700,0	1 000,0	500,0
Plazo de vencimiento		1 d	1 900,0	1 400,0	505,0
Tasas de inter Mínima		3,75	3,75	3,75	3,80
Máxima		3,78	3,76	3,75	3,75
Promedio		3,76	3,75	3,75	3,75
Saldo	4 460,0	5 060,0	4 460,0	3 460,0	2 960,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 07 de agosto de 2017	500,0	2 300,0	2 000,0	1 000,0	0,0
Vencimiento de REPO BCRP del 07 al 11 de agosto de 2017	2 000,0	2 600,0	2 000,0	1 000,0	0,0
<b>iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dolares del BCRP (CDLD BCRP)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 11 de agosto de 2017					
<b>iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</b>					
Propuestas recibidas	900,0				
Plazo de vencimiento	1 358,0				
Tasas de inter Mínima	1 d				
Máxima	2,99				
Promedio	3,58				
Saldo	900,0				
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 07 de agosto de 2017	900,0				
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 07 al 11 de agosto de 2017	900,0				
<b>v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0
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 07 al 11 de agosto de 2017	0,0	0,0	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 inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 11 de agosto de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 07 al 11 de agosto de 2017	0,0	0,0	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 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 07 al 11 de agosto de 2017	0,0	0,0	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 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 07 al 11 de agosto de 2017	0,0	0,0	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 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 07 al 11 de agosto de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP</b>					
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-Venta el 11 de agosto de 2017					
Vencimiento de SC - Venta del 07 al 11 de agosto de 2017					
<b>xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP</b>					
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 el 11 de agosto de 2017					
Vencimiento de SC - Compra del 07 al 11 de agosto de 2017					
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</b>					
i. Compras (millones de US\$)	1 172,7	246,2	3,2	233,2	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)	362,0	76,0	1,0	72,0	0,0
Tipo de cambio promedio	3,2396	3,2392	3,2390	3,2389	
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	54,1	54,1	54,1	54,1	54,1
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
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>1 877,2</b>	<b>4 261,8</b>	<b>3 915,9</b>	<b>3 904,3</b>	<b>3 252,9</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0119%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	1 161,6	13,6	13,6	41,3	188,1
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>715,6</b>	<b>4 248,2</b>	<b>3 902,3</b>	<b>3 863,0</b>	<b>3 064,8</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 198,6	8 496,3	7 183,8	8 361,1	8 061,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,2	8,2	6,5	7,0	6,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	1 973,8	4 248,2	2 915,8	4 119,8	3 822,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,6	4,1	2,6	3,4	3,2
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 055,0	898,0	1 050,0	926,9	958,8
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. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	32,0	59,0	121,0
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 / 1,30 / 1,26
c. Total mercado secundario de CDBCRP - CDBCRP-NR y CDV	297,5	597,1	305,6	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>27 Julio 17</b>	<b>31 Julio 17</b>	<b>01 agosto 17</b>	<b>02 agosto 17</b>	<b>03 agosto 17</b>
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	-8,2	13,4	-77,0	112,2	64,8
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	10,5	-425,0	-176,0	52,0	97,1
<b>a. Mercado spot con el público.</b>					
i. Compras	61,8	298,2	298,2	199,9	282,1
ii. (-) Ventas	66,6	457,1	402,9	233,7	223,0
<b>b. Contratos forward al público (con y sin entrega)</b>					
i. Pactadas	17,3	373,9	98,1	24,3	-219,9
ii. (-) Vencidas	35,7	557,8	127,6	152,3	26,5
<b>c. Ventas forward al público (con y sin entrega)</b>					
i. Pactadas	18,5	183,9	29,4	128,0	246,3
ii. (-) Vencidas	33,8	-58,8	1,2	-36,1	-190,8
<b>d. Operaciones cambiarias interbancarias</b>					
i. Al contado	0,0	385,4	515,7	230,2	383,0
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</b>					
i. Compras	0,0	25,2	82,2	78,3	336,0
ii. (-) Ventas	0,0	134,0	95,0	143,4	473,1
<b>f. Efecto de Opciones</b>					
i. (-) Ventas	0,0	108,8	12,8	65,1	137,1
ii. (-) Compras	-0,1	5,9	2,1	-0,2	-3,3
<b>g. Operaciones netas con otras instituciones financieras</b>					
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	0,0	-361,6	-75,6	25,0	-70,0
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2484	3,2402	3,2386	3,2405	3,2387
(*) Datos preliminares					