

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	21 Agosto 17	22 Agosto 17	23 Agosto 17	24 Agosto 17	25 Agosto 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 397,6	3 063,0	3 844,1	4 450,9	4 775,2
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	200,0	100,0	30,0	200,0
Plazo de vencimiento	185 d	410,0	252,0	185 d	410,0
Tasas de inte Mínima	176 d	106 d	360 d	176 d	106 d
Máxima	3,58	3,57	3,59	3,58	3,59
Promedio	3,58	3,66	3,64	3,60	3,66
Saldo	3,58	3,64	3,62	3,59	3,63
Próximo vencimiento de CD BCRP el 07 de septiembre de 2017	1 015,0	1 015,0	1 015,0	1 015,0	1 015,0
Vencimiento de CD BCRP del 26 al 01 de septiembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 460,0	2 460,0	2 460,0	2 460,0	2 460,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 16 de diciembre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 28 al 01 de septiembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 23 octubre, 2017					
Vencimiento de CDLD BCRP del 28 al 01 de septiembre de 2017					
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	500,1	1100,1	500,1	1000,1	1500,1
Plazo de vencimiento	1212,0	1477,0	850,7	1261,0	2026,7
Tasas de inte Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Máxima	3,60	3,67	3,25	3,60	3,72
Promedio	3,73	3,75	3,70	3,75	3,75
Saldo	3,64	3,64	3,72	3,73	3,72
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo del 28 de agosto 2017	2 100,2	2 450,1	2 800,1	2 800,1	3 351,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 28 al 01 de septiembre de 2017	1 600,2	1 950,1	2 300,1	2 700,1	3 100,1
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público	2 100,2	2 450,1	2 800,1	2 800,1	3 351,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte 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 28 al 01 de septiembre 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 inte 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 01 de septiembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reoutar)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	12 783,1	12 783,1	12 783,1	12 783,1	12 533,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 01 de septiembre de 2017	250,0	250,0	250,0	250,0	250,0
Vencimiento de REPO del 28 al 01 de septiembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expanción)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
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 septiembre de 2017	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de REPO Expansión del 28 al 01 de septiembre 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 inte 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 28 al 01 de septiembre 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 inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el					
Vencimiento de SC - Venta del 28 al 01 de septiembre de 2017					
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra					
Vencimiento de SC - Compra del 28 al 01 de septiembre de 2017					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	16,2	964,9	508,4	731,6	987,3
ii. Ventas (millones de US\$)	3 238,0	3 237,8	3 238,0	3 237,0	3 237,0
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 v BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	54,1	54,1	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	1 483,6	1 877,8	1 722,4	2 101,4	1 862,6
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
i. Comisión (tasa efectiva diaria)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0119%
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por realización monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	18,0	237,5	424,3	1 061,9	1 079,2
Tasa de interés	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 465,6	1 640,3	1 298,1	1 039,6	783,4
f Fondos de encase en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) ⁽¹⁾	6 196,3	6 838,4	6 703,8	6 636,3	6 572,0
g Fondos de encase en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) ⁽¹⁾	5,5	5,6	5,4	5,4	5,4
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 455,8	2 515,3	2 352,5	2 310,6	2 258,0
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) ⁽¹⁾	2,0	2,1	1,9	1,9	1,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 000,0	891,2	737,0	195,0	945,0
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	3,70/3,75/3,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	85,0	74,0	99,0	123,0	118,0
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	18 agosto 17	21 agosto 17	22 agosto 17	23 agosto 17	24 agosto 17
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-109,5	35,2	-86,3	-5,4	-24,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	2,2	23,0	-37,6	-29,0	-34,0
a. Mercado spot con el Banco	-37,3	-120,1	-120,1	-59,0	-59,0
i. Compras	214,5	210,7	299,1	165,1	191,5
ii. Ventas	251,8	330,8	380,8	240,8	245,5
d. <u>Operaciones forward al público (con y sin entrega)</u>	63,2	38,3	75,7	114,5	250,4
i. <u>Prácticas</u>	151,6	254,4	345,4	245,4	425,1
ii. <u>Vencidas</u>	68,4	216,1	269,9	234,9	169,7
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	181,4	31,9	-198,1	-166,1	-67,4
i. <u>Prácticas</u>	276,3	76,4	87,4	127,4	127,6
ii. <u>Vencidas</u>	94,8	44,5	285,5	223,9	195,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	390,5	267,2	465,8	408,9	357,2
ii. A futuro	57,0	36,0	50,0	50,0	23,8
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	84,0	43,7	273,8	202,5	192,8
i. Compras	18,9	87,1	136,1	136,1	133,9
ii. Ventas	-13,5	-5,9	8,4	12,1	0,8
f. Efecto de Operación	0,8	-5,1	-348,3	-224,4	-321,6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
h. <u>Libro por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2425	3,2388	3,2377	3,2379	3,2367
(1) Datos preliminares					