

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	04 Setiembre 17	05 Setiembre 17	06 Setiembre 17	07 Setiembre 17	08 Setiembre 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	6 004,0	6 684,0	6 603,8	8 463,8	7 696,1
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	30,0	30,0
Plazo de vencimiento	151 d				
Tasas de Inte Mínima	190 d	547 d	547 d	384 d	384 d
Máxima	3,6	3,6	3,6	3,51	3,51
Promedio	3,6	3,8	3,8	3,61	3,61
Saldo	28 388,4	28 388,4	28 418,4	27 433,4	27 433,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de setiembre de 2017	1 015,0	1 015,0	1 015,0	740,0	740,0
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 15 de setiembre de 2017	1 015,0	1 015,0	1 015,0	740,0	740,0
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 18 de diciembre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 11 al 15 de setiembre 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	1 095,0	1 295,0	1 295,0	1 795,0	2 095,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 23 octubre, 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 11 al 15 de setiembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1000,0	950,0	1500,0	500,0	500,0
Plazo de vencimiento	2930,5	2936,0	2491,5	500,0	1000,0
Tasas de Inte Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Máxima	3,00	2,90	2,95	3,10	2,85
Promedio	3,45	3,15	3,25	3,44	3,00
Saldo	1 950,0	3 000,0	3 600,0	6 300,0	7 500,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 11 de setiembre 2017	1 950,0	1 950,0	2 600,0	2 600,0	5 000,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 11 al 15 de setiembre de 2017	1 950,0	1 950,0	2 600,0	2 600,0	7 500,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
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 11 al 15 de setiembre 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 11 al 15 de setiembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reoular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 833,1	11 833,1	11 833,1	11 833,1	11 833,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 03 de octubre de 2017	20,0	20,0	20,0	20,0	20,0
Vencimiento de REPO del 11 al 15 de setiembre 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 Inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 950,0	4 950,0	4 950,0	4 950,0	4 350,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 15 de setiembre de 2017	600,0	600,0	600,0	600,0	300,0
Vencimiento de REPO Expansión del 11 al 15 de setiembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	300,0
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 del 11 al 15 de setiembre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 11 al 15 de setiembre 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 11 al 15 de setiembre 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 11 al 15 de setiembre de 2017					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	197,5	262,2	527,5	841,1	905,3
ii. Ventas (millones de US\$)	3 237,0	3 237,0	3 236,0	3 239,0	3 233,1
iii. 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	54,1	54,1	54,1	54,1	54,1
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	4 221,4	3 946,2	4 201,3	3 974,9	3 011,4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
i. Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0119%
ii. Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
b. Crédito por realización monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
c. Depósitos Overnight en moneda nacional	190,0	71,0	271,0	80,0	540,0
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	4 031,4	3 875,2	3 930,3	3 894,9	2 471,4
f Fondos de encargo en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 746,8	8 198,9	8 266,7	8 286,1	8 349,7
g Fondos de encargo en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,4	6,5	6,7	6,6	6,7
h Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 324,5	3 769,1	3 796,0	3 825,2	3 894,9
i Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,2	3,0	3,0	3,1	3,1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 411,0	1 394,0	1 063,5	912,5	245,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,75/3,80/3,76	3,75/3,80/3,76	44,5	3,70/3,75/3,75	3,00/3,75/3,46
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	67,0	18,5	173,2	13,0	28,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,25 / 1,37 / 1,29	1,30 / 1,42 / 1,34	1,35 / 1,40 / 1,36	1,35 / 1,35 / 1,35	2,00 / 2,00 / 2,00
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	139,0	997,9	1 390,0	1 728,8	1 728,8
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	20,0 / 3,58		100,0 / 3,58	100,0 / 3,58	39,0 / 3,58
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				14,0 / 3,59	
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	01 setiembre 17	04 setiembre 17	05 setiembre 17	06 setiembre 17	07 setiembre 17
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-82,1	77,9	-88,2	-0,2	13,5
Flujo de la posición contable = a + b.i - c.i + e + f + g	-98,5	-63,0	-29,8	-141,1	-113,7
a. Mercado spot con el público					
i. Compras	192,0	192,5	173,2	175,4	347,2
ii. Ventas	298,9	210,5	194,5	372,4	372,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	15,1	129,8	167,8	157,6	218,0
i. Factadas	288,9	163,6	238,9	428,6	428,6
ii. Vencidas	53,3	33,9	71,1	107,7	238,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-1,3	-11,0	-3,2	17,3	-208,2
i. Factadas	86,2	6,0	80,1	15,7	153,7
ii. Vencidas	87,5	17,0	93,4	76,1	361,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	249,0	223,2	367,0	286,0	534,9
ii. A futuro	33,0	10,0	10,0	8,0	35,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	36,9	11,2	35,6	1,1	153,5
i. Compras	36,9	12,8	87,0	76,1	360,6
ii. Ventas	40,6	1,6	51,4	75,0	201,1
f. Efecto de Opciones	0,0	0,2	0,5	0,7	1,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-15,7	-73,0	-153,8	-164,7	-413,7
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2383	3,2381	3,2365	3,2360	3,2347
(*) Datos preliminares					