BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	11 Setiembre 17	12 Setiembre 17	13 Setiembre 17	14 Setiembre 17	15 Setiembre 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**8 442,0**	**9 027,1**	**8 958,3**	**9 592,5**	**8 021,9**
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)		366.0	30.0 300.0 150.0 535.0	360.0 30.0 250.0 204.0 154.4	284.9 551.0 729.0
Propuestas recibidas	30.0	593.5	114.6 975.0 595.9 859.5	1124.5 210.0 366.5 513.5 244.4	784.9 638.0 874.0
Plazo de vencimiento	176.0	182.0	540 d 181 d 90 d 181 d	182 d 362 d 89 d 182 d 362 d	181 d 88 d 181 d
Tasas de inter Mínima	183 d	3.56	3.61 3.56 3.55 3.52	3.55 3.57 3.53 3.55 3.56	3.46 3.42 3.47
Máxima	3.50	3.58	3.65 3.58 3.56 3.58	3.56 3.57 3.55 3.55 3.57	3.50 3.50 3.50
Promedio	3.59	3.58	3.64 3.57 3.56 3.55	3.55 3.57 3.55 3.55 3.57	3.50 3.50 3.50
Saldo	3.57	27 829.4	28 844.4	29 102.8	30 667.7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 02 de octubre de 2017	27 463.4	740.0	740.0	200.0	200.0
Vencimiento de CD BCRP del 18 al 22 de setiembre de 2017	740.0	740.0	740.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter 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 18 al 22 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 inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 095.0	2 095.0	2 095.0	2 095.0	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 18 al 22 de setiembre de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	500.0 3000.0 250.0 2750.1	250.0 3500.0 500.0 1500.0 1350.0	3500.1 2784.7	4500.0 2895.8	3500.1 1679.0
Propuestas recibidas	1127.0 3722.1 955.3 3269.2	1194.0 5298.2 1055.0 1538.1 1520.4	4311.1 2784.7	5175.4 2898.8	4005.9 1688.0
Plazo de vencimiento	7 d 1 d 7 d 1 d	7 d 1 d 7 d 1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de inter Mínima	3.08 2.90 3.24 2.84	3.19 2.98 3.44 3.10 2.95	3.10 3.09	3.40 3.30	2.87 2.45
Máxima	3.29 3.73 3.29 3.70	3.34 3.56 3.71 3.72 3.70	3.72 3.75	3.71 3.75	3.50 3.50
Promedio	3.29 3.05 3.28 3.26	3.28 3.30 3.59 3.53 3.42	3.50 3.59	3.57 3.65	3.41 3.29
Saldo	9 000.1	9 850.0	9 284.8	9 395.8	6 679.1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 18 de setiembre 2017	6 250.1	6 850.0	7 284.8	7 895.8	5 929.1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 18 al 22 de setiembre de 2017	8 250.1	8 350.0	7 784.8	7 895.8	6 679.1
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
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 18 al 22 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 inter 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 18 al 22 de setiembre de 2017	0.0	0.0	0.0	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	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 18 al 22 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 inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 350.0	4 350.0	4 350.0	4 350.0	4 050.0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 03 de Octubre de 2017	300.0	300.0	300.0	300.0	20.0
Vencimiento de REPO Expansión del 18 al 22 de setiembre de 2017	300.0	300.0	300.0	300.0	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	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 Sustitución del 18 al 22 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 inter 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 18 al 22 de setiembre 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	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de SC - Compra del 18 al 22 de setiembre de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	565.4	32.3	0.0	218.6	0.0
i. Compras (millones de US$)	175,0	10,0		67,5	
Tipo de cambio promedio	3.2310	3.2339		3.2380	
ii. Ventas (millones de US$)					
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$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	54.1	54.1	54.1	54.1	54.1
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 477,3**	**1 593,4**	**1 658,5**	**1 416,8**	**1 277,9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0109%	0.0109%	0.0109%	0.0109%	0.0108%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4.30%	4.30%	4.30%	4.30%	4.30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	92.3	65.5	64.8	24.1	21.6
Tasa de interés	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%	2.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2 385,0**	**1 527,9**	**1 593,7**	**1 392,7**	**1 256,3**
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	7 910,3	7 952,5	7 700,4	7 572,5	7 480,7
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,3	6,3	6,1	6,0	5,9
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 448,2	3 478,7	3 191,9	3 048,0	2 933,8
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,8	2,8	2,5	2,4	2,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	200.0	535.0	456.0	975.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		3,75/3.75/3,75	3,70/3.7/3,70	3,70/3.70/3,70	3,50/3.75/3,60
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	60.0	48.0	15.0	28.0	79.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	2.00 /2.30 / 2.10	2.25 /3.00 / 2.50	2.50/2.50/2.50	3.00/3.05/3.05	3.25/3.30/3.26
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR v CDV	51.0	75.0		25.0	70.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	41.0 / 3.58	45.0 / 3.57		10.0 / 3.56	70.0 / 3.50
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				10.0 / 3.56	
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**08 setiembre 17**	**11 setiembre 17**	**12 setiembre 17**	**13 setiembre 17**	**14 setiembre 17**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-76,8	-11,0	101,7	-28,6	25,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-167,0	-12,4	141,8	86,6	143,8
a. Mercado spot con el público	224,1	166,7	131,2	98,6	150,3
i. Compras	394,0	336,7	306,6	310,8	354,9
ii. (-) Ventas	170,0	169,9	175,4	212,3	204,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	181,3	188,8	74,1	-66,3	-251,1
i. Pactadas	265,4	260,4	266,9	154,5	107,7
ii. (-) Vencidas	84,1	71,6	192,9	220,7	358,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	90,5	188,1	113,3	45,0	-135,2
i. Pactadas	114,0	222,5	161,6	236,1	348,3
ii. (-) Vencidas	23,5	34,4	48,3	191,2	483,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	173,0	285,2	220,8	332,9	443,7
ii. A futuro	129,0	121,0	39,0	57,0	37,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-39,5	-36,5	-120,4	-27,7	184,7
i. Compras	23,0	22,7	45,3	179,8	482,6
ii. (-) Ventas	62,6	59,1	165,6	207,5	297,9
f. Efecto de Opciones	-0,6	0,6	-0,8	-4,0	-2,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-412,2	-179,8	-13,6	-13,9	-66,5
h. Efecto por reajuste monetario en monedas extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2332	3,2310	3,2340	3,2390	3,2387
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera