

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	25 Setiembre 17	26 Setiembre 17	27 Setiembre 17	28 Setiembre 17	29 Setiembre 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 544,0	3 966,3	3 634,2	3 676,6	3 528,5
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	216,0	30,0	145,5	260,0
Plazo de vencimiento	170,0	453,0	100,0	205,5	350,0
Tasas de interés	192 d	191 d	526 d	30 d	348 d
Mínima	3,50	3,50	3,60	3,20	3,57
Máxima	3,50	3,50	3,62	3,50	3,59
Promedio	3,50	3,50	3,60	3,58	3,59
Saldo	32 582,7	32 798,7	32 974,2	33 179,2	33 459,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 02 de octubre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de CD BCRP del 02 al 06 de octubre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	1 200,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
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 02 al 06 de octubre 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 interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 195,0	2 195,0	2 195,0	2 195,0	2 195,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 23 octubre, 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 02 al 06 de octubre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	250,3	1 000,0	945,1	50,1	1 000,1
Plazo de vencimiento	381,0	1 156,0	945,1	61,0	1 156,0
Tasas de interés	7 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Mínima	3,17	3,29	2,98	3,43	3,30
Máxima	3,50	3,50	3,50	3,50	3,50
Promedio	3,47	3,44	3,50	3,49	3,30
Saldo	2 445,4	2 964,2	2 627,0	1 963,0	2 734,5
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 02 de octubre 2017	2 195,5	2 195,5	1 963,0	1 963,0	2 734,9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 02 al 06 de octubre de 2017	2 195,5	2 195,5	1 963,0	1 963,0	2 734,9
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
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 02 al 06 de octubre 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 interés					
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 02 al 06 de octubre 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 interés					
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 02 al 06 de octubre 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 interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 03 de Octubre de 2017	20,0	20,0	20,0	20,0	20,0
Vencimiento de REPO Expansión del 02 al 06 de octubre 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 interés					
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 02 al 06 de octubre 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 interés					
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 02 al 06 de octubre de 2017					
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra					
Vencimiento de SC - Compra del 02 al 06 de octubre de 2017					
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					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 318,6	1 036,0	1 495,7	1 378,8	1 198,0
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%	0,0107%	0,0108%	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	4,41%	1,93%	6,30%	7,16%	1,53%
Depósitos Overnight en moneda nacional	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%
Tasa de interés	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 274,5	842,7	864,9	662,8	1 045,0
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)					
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)					
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)					
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)					
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	71,0	61,0	30,5	27,0	27,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	1,501,50/1,50	1,251,25/1,25	1,251,25/1,25	1,251,25/1,25	1,251,25/1,25
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	443,1	221,1	339,0	424,4	424,6
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)		10,0 / 3,50	84,0 / 3,50	88,0 / 3,50	327,5 / 3,50
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)					
a. Flujo de la posición global = a + b1 - c + e + f + g					
Flujo de la posición contable = a + b1 - c + e + f + g	21,9	33,8	-16,9	33,3	-75,8
b. Mercado spot con el público					
i. Compras	-15,7	123,7	55,4	-58,3	-108,0
ii (-) Ventas	-2,2	125,2	86,5	-1,5	-101,8
iii (-) Ventas	291,5	270,3	293,2	285,2	327,9
c. Compras forward al público (con y sin entrega)					
i. Compras	286,5	145,0	231,8	266,7	429,8
ii (-) Ventas	42,7	69,2	-102,6	-36,0	132,4
iii (-) Ventas	104,6	215,6	320,4	289,0	353,7
d. Compras forward al público (con y sin entrega)					
i. Compras	61,8	146,6	423,0	305,0	221,3
ii (-) Ventas	5,9	150,0	150,0	-93,7	108,4
iii (-) Ventas	96,0	211,8	235,2	153,9	189,8
e. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Compras	90,1	61,8	135,2	252,6	84,4
ii (-) Ventas	397,5	447,7	707,2	605,4	744,5
iii (-) Ventas	46,9	31,0	23,9	15,0	0,0
f. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega					
i. Compras	17,8	-89,2	-77,1	-136,3	-136,3
ii (-) Ventas	74,4	48,0	94,9	225,7	58,4
g. Efecto de Opciones					
i. Compras	56,6	416,2	416,2	302,8	196,6
ii (-) Ventas	0,8	-3,1	-13,5	12,0	2,3
h. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
Tasa de interés	-0,1	-0,2	0,4	-0,2	-0,8
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datarec)	3,2471	3,2562	3,2701	3,2753	3,2688
(*) Datos preliminares					