

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	16 Octubre 17		17 Octubre 17		18 Octubre 17		19 Octubre 17		20 Octubre 17	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 686,6		3 646,9		3 345,9		3 760,1		3 572,6	
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones										
a. Operaciones monetarias anuladas del BCR										
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)										
Propuestas recibidas	29,9	150,0	125,0	30,0	145,0	30,0	150,0	100,0	100,0	172,4
Plazo de vencimiento	138,0	397,0	254,0	105,0	265,0	60,0	235,0	58,0	58,0	38,0
Tasas de inte Mínima	3,50	3,49	3,50	3,59	3,50	3,50	3,51	3,51	3,51	3,35
Máxima	3,50	3,55	3,51	3,59	3,51	3,55	3,51	3,51	3,51	3,53
Promedio	3,50	3,51	3,51	3,59	3,51	3,55	3,51	3,51	3,51	3,51
Saldo	33 463,4	33 588,4	33 588,4	33 763,4	33 763,4	33 038,4	33 138,4	33 138,4	33 138,4	33 138,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de octubre de 2017	920,0	920,0	920,0	920,0	920,0	145,5	145,5	145,5	145,5	145,5
Vencimiento de CD BCRP del 23 al 27 de octubre de 2017	920,0	920,0	920,0	920,0	920,0	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	2 460,0	2 460,0	2 460,0	2 460,0	2 460,0
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 18 de diciembre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 23 al 27 de octubre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	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	2 395,0	2 395,0	2 395,0	2 395,0	2 395,0	2 595,0	2 595,0	2 595,0	2 595,0	2 595,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 23 octubre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 23 al 27 de octubre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional										
Propuestas recibidas	300,1	1150,0	299,9	400,0	1150,0	199,9	0,0	2450,0	100,1	2100,0
Plazo de vencimiento	648,0	1535,2	1082,7	744,5	1204,4	714,0	2480,0	416,0	2106,5	2106,5
Tasas de inte Mínima	7 d	1 d	7 d	1 d	7 d	1 d	7 d	1 d	7 d	1 d
Máxima	3,45	3,15	3,39	2,96	3,40	3,07	3,29	3,11	3,34	3,03
Promedio	3,49	3,32	3,47	3,33	3,43	3,40	3,44	3,48	3,42	3,49
Saldo	3 250,2	3 250,1	3 250,1	3 150,1	3 150,1	4 150,0	4 150,0	4 150,0	4 150,0	3 400,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 20 de octubre 2017	1 650,0	1 650,0	1 650,0	1 650,0	1 650,0	2 950,1	2 950,1	2 950,1	2 950,1	2 400,1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 23 al 27 de octubre de 2017	2 950,1	2 950,1	2 950,1	2 950,1	2 950,1	2 950,1	2 950,1	2 950,1	2 950,1	3 400,0
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	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0
Próximo vencimiento de Colo-TP el 19 de diciembre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de Colo-TP del 23 al 27 de octubre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables 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	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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 23 al 27 de octubre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Reconora de moneda extranjera (Reopar)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de inte Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	11 813,1	11 813,1	11 813,1	11 813,1	11 813,1	11 813,1	11 813,1	11 813,1	11 813,1	11 813,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 02 de noviembre de 2017	588,0	588,0	588,0	588,0	588,0	588,0	588,0	588,0	588,0	588,0
Vencimiento de REPO del 23 al 27 de octubre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Expansión)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de inte Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0
Próximo vencimiento de Reco Expansión el 16 de Marzo de 2018	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de REPO Expansión del 23 al 27 de octubre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Reconpra 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	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	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 23 al 27 de octubre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el										
Vencimiento de SC - Venta del 23 al 27 de octubre 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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra										
Vencimiento de SC - Compra del 23 al 27 de octubre de 2017										
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR										
i. Compras (millones de US\$)	54,1	54,1	54,1	54,1	54,1	54,1	54,1	54,1	54,1	54,1
ii. Ventas (millones de US\$)										
Tipo de cambio promedio										
Tipo de cambio										
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	2 050,6		1 872,0		1 620,9		933,4		1 272,5	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps):										
Comisión (tasa efectiva diaria)										
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)										
Tasa de interés										
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional										
Tasa de interés										
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 924,5		1 731,4		1 604,3		901,8		1 228,6	
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										
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)										
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio										
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV										
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\$)	13 octubre 17		16 octubre 17		17 octubre 17		18 octubre 17		19 octubre 17	
Flujo de la posición global $a + d - j - k + l + m + n$										
Flujo de la posición contable $a + b - c + e + g$										
a. Mercado spot con el público:										
i. Compras										
ii. Ventas										
b. Compras forward al público (con y sin entrega)										
i. Pactadas										
ii. Ventadas										
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)										
i. Pactadas										
ii. i. Ventadas										
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado										
ii. A futuro										
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega										
i. Compras										
ii. Ventas										
f. Efecto de Opciones										
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras										
h. Líquido por regulación monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)										
(1) Datos preliminares										