

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	04 Diciembre 17	05 Diciembre 17	06 Diciembre 17	07 Diciembre 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	6 311,4	2 303,2	5 425,6	4 872,7
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
Plazo de vencimiento	72,0		110,0	213,0
Tasas de Inter Mínima	185,4		547,4	364,4
Máxima	3,28		3,36	3,30
Promedio	3,33		3,39	3,35
Saldo	3,32		3,38	3,34
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de diciembre de 2017	33 577,1	32 340,1	32 370,1	31 194,9
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 15 de diciembre de 2017	1 237,0	1 220,2	1 220,2	1 160,9
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 15 de diciembre de 2017	1 237,0	1 220,2	1 220,2	1 360,9
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas	2 450,0	1 250,1	1 450,0	800,0
Plazo de vencimiento	2 500,0	1 600,0	2 050,0	820,0
Tasas de Inter Mínima	1,4	1,4	1,4	4,4
Máxima	3,25	3,25	3,25	3,25
Promedio	3,26	3,26	3,25	3,26
Saldo	3,25	3,25	3,25	3,26
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 11 de diciembre de 2017	4 910,0	3 710,0	3 909,9	3 259,9
Vencimiento de REPO BCRP del 11 al 15 de diciembre de 2017	2 450,0	1 250,1	1 450,0	800,0
Vencimiento de REPO BCRP del 11 al 15 de diciembre de 2017	2 450,0	1 250,1	1 450,0	900,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDDL BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	1 200,0	1 200,0	1 200,0	1 200,0
Próximo vencimiento de CDDL BCRP el 12 diciembre, 2017	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de CDDL BCRP del 11 al 15 de diciembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	200,0	200,0	200,0	200,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 11 al 15 de diciembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0
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
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 19 de diciembre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de Coloc-TP del 11 al 15 de diciembre de 2017	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
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 11 al 15 de diciembre de 2017	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	9 100,1	9 100,1	9 100,1	8 900,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 05 de enero de 2018	200,0	200,0	200,0	300,0
Vencimiento de REPO del 11 al 15 de diciembre de 2017	200,0	200,0	200,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 16 de Marzo de 2018	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de REPO Expansión del 11 al 15 de diciembre de 2017	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 Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	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
Vencimiento de REPO Sustitución del 11 al 15 de diciembre de 2017	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
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 al 15 de diciembre de 2017				
Vencimiento de SC - Venta del 11 al 15 de diciembre 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
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 11 al 15 de diciembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
Ventas (millones de US\$)				
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	200,00	400,00	200,00	200,00
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	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	3 831,4	3 553,3	3 945,6	4 042,7
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%	0,0105%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	3,47	1,9	23,4	9,1
d. Depósitos Overnight en moneda nacional				
Tasa de interés	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 796,7	3 551,4	3 922,2	4 033,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 711,7	7 872,5	8 029,7	8 071,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,1	6,0	6,1	6,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 061,7	3 290,9	3 463,0	3 488,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,4	2,5	2,6	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	973,2	1 065,0	750,0	970,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,25/3,25/3,25	3,25/3,25/3,25	3,25/3,25/3,25	3,25/3,25/3,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	29,0	49,0	32,0	24,0
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
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	25,0	48,0	158,0	10,0
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\$)	01 diciembre 17	04 diciembre 17	05 diciembre 17	06 diciembre 17
Flujo de la posición global = a + b) - c) + e + f + g	-50,9	-86,5	39,3	-82,3
Flujo de la posición contable = a + b) - c) + e + f + g	25,0	32,5	30,1	86,5
a. Mercado spot con el público	60,8	26,4	49,9	162,2
i. Compras	266,3	270,7	309,6	401,5
ii. (i) Ventas	205,4	245,3	259,8	239,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	107,1	-171,6	-5,4	-105,5
i. Pactadas	117,4	121,7	165,4	101,5
ii. (i) Ventas	10,3	293,3	170,8	207,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	183,3	-74,0	-9,4	52,3
i. Pactadas	188,8	88,5	157,8	137,5
ii. (i) Ventas	5,4	172,5	167,2	85,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	512,6	265,0	437,8	391,7
ii. A futuro	31,0	9,0	25,0	5,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-2,3	-113,7	-17,2	-157,2
i. Compras	4,1	170,1	151,1	48,8
ii. (i) Ventas	6,4	283,8	168,3	206,0
f. Saldo de Depósitos	0,4	-1,5	5,1	-1,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-36,4	0,1	-6,2	-30,3
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2330	3,2342	3,2356	3,2365
(*) Datos preliminares				