

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	02 Octubre 17	03 Octubre 17	04 Octubre 17	05 Octubre 17	06 Octubre 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 621,9	3 795,0	4 093,1	4 320,3	5 480,7
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 BCR (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	30,0		30,0	30,0	251,0
Plazo de vencimiento	160,0		118,0	182,3	581,0
Tasas de Interés Mínima	190 d		554 d	371 d	186 d
Máxima	3,50		3,55	3,52	3,50
Promedio	3,50		3,61	3,54	3,51
Saldo	3,50		3,60	3,53	3,51
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de octubre de 2017	33 284,2	33 284,2	33 329,2	32 595,7	32 646,7
Vencimiento de CD BCRP del 09 al 13 de octubre de 2017	1 000,0	1 000,0	1 000,0	1 240,0	1 240,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1 000,0	1 000,0	1 000,0	0,0	1 240,0
Plazo de vencimiento	300,0	300,0	300,0		
Tasas de Interés Mínima	1 d	1 d	1 d		
Máxima	3,50	3,50	3,50		
Promedio	3,50	3,50	3,50		
Saldo	2 460,0	2 760,0	2 460,0	2 460,0	2 460,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 18 de diciembre de 2017	200,0	300,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 09 al 13 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 09 al 13 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					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 099,8	1 099,8	1 099,8	1 099,8	1 299,9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 09 de octubre 2017	1 725,5	1 725,5	1 725,5	1 725,5	2 167,4
Vencimiento de Depósitos a Plazo el 09 al 13 de octubre de 2017	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
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 Depósitos a Plazo el 09 de octubre 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo el 09 al 13 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	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 09 al 13 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	11 813,1	11 813,1	11 813,1	11 813,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 02 de noviembre de 2017	20,0	588,0	588,0	588,0	588,0
Vencimiento de REPO del 09 al 13 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 Expansión el 03 de Octubre de 2017	20,0	20,0	20,0	20,0	20,0
Vencimiento de REPO Expansión del 09 al 13 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 09 al 13 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 al					
Vencimiento de SC - Venta del 09 al 13 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 09 al 13 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	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	3 591,9	4 095,0	4 063,1	4 090,3	3 929,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0,0108%	0,0108%	0,0108%	0,0108%	0,0108%
Tasa de interés					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	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	150,0	173,7	250,0	185,4	29,0
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	3 441,9	3 921,3	3 813,1	3 904,9	3 900,8
e. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	6 886,5	7 262,9	7 252,1	7 636,8	7 799,9
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,7	6,7	5,6	5,9	6,0
g. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 243,4	2 609,7	2 635,6	3 022,2	3 196,3
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,2	2,4	2,0	2,3	2,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 033,8	1 278,0	1 555,6	1 230,0	1 032,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50	3,25/3,55/3,50	3,50/3,55/3,51	3,50/3,50/3,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	25,0	36,8	122,3	121,3	151,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,25/1,30/1,27	1,25/1,30/1,26	1,25/1,30/1,25	1,25/1,30/1,25	1,25/1,60/1,59
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	618,0	1 025,0	1 169,9	1 339,0	1 545,6
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	50,0 / 3,50				100,0 / 3,50
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	29 setiembre 17	02 octubre 17	03 octubre 17	04 octubre 17	05 octubre 17
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	54,1	-46,5	99,5	54,7	59,4
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	64,8	40,1	64,0	64,0	60,2
a. Mercado spot con el público	-26,5	46,1	37,5	70,2	58,9
i. Compras	409,1	220,5	269,7	287,8	326,7
ii. (-) Ventas	435,6	174,4	232,1	217,6	267,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	55,2	-60,2	-40,1	15,8	-7,6
i. Placidas	272,1	85,1	83,1	165,9	183,0
ii. (-) Vencidas	216,9	125,9	123,1	150,1	200,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	70,5	23,9	-137,2	34,5	-3,1
i. Placidas	155,1	121,3	139,1	71,9	167,2
ii. (-) Vencidas	84,6	97,4	276,3	37,4	170,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	439,0	316,0	561,4	346,0	618,7
ii. A futuro	28,0	9,0	10,0	20,0	84,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-39,1	-37,9	-117,0	122,6	-27,6
i. Compras	71,6	78,7	243,6	31,1	168,9
ii. (-) Ventas	110,7	116,6	141,0	194,5	194,5
f. Efecto de Operaciones	4,7	-2,5	2,2	9,4	3,7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-2,0	3,3	-6,8	-1,9	-1,3
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datarec)	3,2659	3,2699	3,2670	3,2583	3,2546
(*) Datos preliminares					