

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	26 Diciembre 17	27 Diciembre 17	28 Diciembre 17	29 Diciembre 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	-495,5	-928,7	901,8	1 243,1
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	
Plazo de vencimiento		94,0	215,5	
Tasas de Inter Mínima		526 d	343 d	
Máxima		3,10	3,00	
Promedio		3,25	3,10	
Saldo		3,17	3,08	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 04 de enero de 2018	30 687,2	30 717,2	30 747,2	30 747,2
Vencimiento de CD BCRP del 03 al 05 de enero de 2018		60,0		60,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas	1000,0	1000,0	500	500,0
Plazo de vencimiento	2160,0	1150,0	450	500,0
Tasas de Inter Mínima	1 d	1 d	1 d	7 d
Máxima	3,28	3,25	3,26	3,29
Promedio	3,50	3,25	3,36	3,33
Saldo	3,31	3,25	3,26	3,30
Próximo vencimiento de Repo BCRP el 03 al 05 de enero de 2018	4 559,9	4 609,9	4 609,9	4 609,9
Vencimiento de REPO BCRP del 03 al 05 de enero de 2018		500,0		500,0
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	400,0	400,0	400,0	400,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 29 enero, 2018		400,0		400,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 03 al 05 de enero de 2018				
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
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 Coloc-TP el 20 de junio de 2018		300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 03 al 05 de enero de 2018				
v. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	835,0	835,0	835,0	835,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 15 febrero 2018		835,0		835,0
Vencimiento de CDR BCRP del 03 al 05 de enero de 2018		0,0		0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	8 900,1	8 900,1	8 900,1	8 900,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 05 de enero de 2018		300,0		300,0
Vencimiento de REPO del 03 al 05 de enero de 2018		0,0		300,0
vii. 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
Vencimiento de REPO Expansión del 03 al 05 de enero de 2018		0,0		0,0
viii. 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
Vencimiento de REPO Sustitución del 03 al 05 de enero de 2018		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				
Vencimiento de SC - Venta del 03 al 05 de enero de 2018				
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				
Vencimiento de SC - Compra del 03 al 05 de enero de 2018				
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0
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				1 869,79
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público				1 869,79
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	1 954,5	1 541,3	1 371,8	2 053,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0109%
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				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	677,9	689,3	654,2	869,1
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	1 276,6	852,0	717,6	1 184,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 202,8	7 270,4	7 151,0	7 060,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	5,3	5,4	5,3	5,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 610,4	2 554,0	2 425,9	2 383,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	1,8	1,9	1,8	1,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	816,0	969,0	1 552,0	1 410,0
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\$)	13,5	16,0	37,0	20,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,50/1,50/1,50	1,50/1,50/1,50	1,50/1,50/1,50	1,50/1,50/1,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	16,2	50,0	14,2	14,2
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				14,2 / 3,10
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	22 diciembre 17	26 diciembre 17	27 diciembre 17	28 diciembre 17
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	51,4	-51,0	24,7	-43,6
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	142,6	-43,9	88,5	78,8
a. Mercado spot con el público	89,8	23,3	34,2	62,8
i. Compras	349,2	301,8	353,3	439,7
ii (-) Ventas	259,4	278,5	319,1	376,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	18,0	3,3	-64,5	-145,8
i. Placadas	235,1	83,4	140,0	114,7
ii (-) Vencidas	217,1	80,1	194,5	260,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	128,7	8,1	7,7	-29,2
i. Placadas	328,9	170,0	167,0	147,6
ii (-) Vencidas	200,2	162,0	159,3	176,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	493,2	104,0	240,0	437,0
ii. A futuro	37,0	0,0	25,0	11,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-87,0	16,3	-38,6	-98,0
i. Compras	121,4	84,0	145,9	144,0
ii (-) Ventas	208,3	67,7	184,5	242,0
f. Efecto de Opciones	19,5	-2,2	-1,6	-5,8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	122,9	-1,7	57,5	30,2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datarec)	3,2376	3,2393	3,2416	3,2428
(*) Datos preliminares				