

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	23 Octubre 17	24 Octubre 17	25 Octubre 17	26 Octubre 17	27 Octubre 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 146,1	2 958,6	3 167,3	3 774,5	3 350,2
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	30,0	60,0	30,0	30,0	200,0
Plazo de vencimiento	66,0	60,0	115,0	145,0	235,0
Tasas de Inte Mínima	176 d	64 d	533 d	364 d	91 d
Máxima	3,51	3,50	3,57	3,54	3,49
Promedio	3,51	3,54	3,60	3,55	3,53
Saldo	33 228,4		33 258,4	33 448,4	33 502,9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 07 de noviembre de 2017	145,5		145,5		900,0
Vencimiento de CD BCRP del 30 de octubre al 03 de noviembre de 2017	145,5	33 228,4	145,5		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
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 18 de diciembre de 2017	200,0		200,0		200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 30 de octubre al 03 de noviembre de 2017	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	2 095,0	2 045,0	2 045,0	1 900,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 03 noviembre, 2017	300,0		145,0		200,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 30 de octubre al 03 de noviembre de 2017	895,0		145,0		200,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	300,1	1366,0	499,9	1400,0	400,0
Plazo de vencimiento	7 d	1 d	7 d	1 d	6 d
Tasas de Inte Mínima	3,38	3,11	3,39	3,16	3,39
Máxima	3,47	3,49	3,46	3,44	3,39
Promedio	3,43	3,38	3,44	3,33	3,43
Saldo	2 666,0	2 900,0	3 300,0	3 700,2	3 986,6
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 30 de octubre 2017	1 665,9		1 999,9		2 586,7
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 30 de octubre al 03 de noviembre de 2017	2 666,0		2 100,0		3 986,6
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
Próximo vencimiento de Colo-TP el 19 de diciembre de 2017	200,0		200,0		200,0
Vencimiento de Colo-TP del 30 de octubre al 03 de noviembre de 2017	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
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 30 de octubre al 03 de noviembre de 2017	0,0		0,0		0,0
vii. Compra con compromiso de Reconoma de moneda extranjera (Regular)					
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
Próximo vencimiento de Repo Regular el 02 de noviembre de 2017	588,0		588,0		588,0
Vencimiento de REPO del 30 de octubre al 03 de noviembre de 2017	0,0		0,0		0,0
viii. Compra con compromiso de Reconoma 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
Próximo vencimiento de Reco Expansión el 16 de Marzo de 2018	500,0		500,0		500,0
Vencimiento de REPO Expansión del 30 de octubre al 03 de noviembre de 2017	0,0		0,0		0,0
ix. Compra con compromiso de Reconoma 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
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de enero de 2018	200,0		200,0		200,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 30 de octubre al 03 de noviembre de 2017	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
Próximo vencimiento de SC-Venta el					
Vencimiento de SC - Venta del 30 de octubre al 03 de noviembre 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
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de SC - Compra del 30 de octubre al 03 de noviembre de 2017	0,0		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	292,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)			81,0		0,0
ii. Ventas (millones de US\$)			3,240		
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	54,1	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	1 390,0	1 058,7	1 199,3	1 184,4	863,6
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swap):					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0108%
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	121,9	92,8	276,3	541,4	390,7
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	1 266,1	965,9	923,1	943,0	472,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 153,7	7 218,7	7 045,5	6 998,5	6 870,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,5	5,5	5,4	5,4	5,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 541,7	2 476,1	2 414,0	2 353,6	2 283,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,9	2,0	1,8	1,8	1,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 603,2	701,0	1 441,0	869,0	795,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,55/3,51	3,50/3,55/3,50	3,50/3,55/3,51	3,50/3,55/3,51	3,50/3,50/3,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	76,5	118,0	79,0	35,0	4,0
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	1,25/1,25/1,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	50,0	0,0	0,0	15,0	90,0
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\$)	20 octubre 17	23 octubre 17	24 octubre 17	25 octubre 17	26 octubre 17
Flujo de la posición global a = D1 - C1 + e + f + g	-52,4	82,0	-36,1	154,9	-13,3
Flujo de la posición contable a = b1 - c1 + e + f + g	44,6	82,0	89,1	163,9	129,0
a. Mercado spot con el público	87,5	73,5	32,5	314,6	414,6
Compras	262,4	237,4	202,4	296,9	278,3
ii. (i) Ventas	174,9	163,9	172,9	282,3	278,3
b. Compra forward al público (con y sin entrega)	99,4	33,0	69,3	251,7	71,6
L. Pactadas	176,3	140,3	170,8	212,0	143,3
ii. (i) Ventas	76,9	107,3	110,6	463,7	214,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	198,4	137,3	137,3	238,6	69,4
L. Pactadas	255,2	396,2	273,9	107,2	207,6
ii. (i) Ventas	56,8	198,6	198,6	346,0	138,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	469,2	392,0	392,0	427,5	410,4
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	0,5	10,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-35,4	72,7	-34,3	-191,0	-76,2
i. Compras	37,8	174,6	72,6	270,0	156,4
ii. (i) Ventas	73,2	101,8	106,9	461,1	211,6
f. Efecto de Opciones	2,0	-1,6	0,1	3,9	1,8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-27,7	27,4	66,7	-77,4	-7,9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2388	3,2393	3,2400	3,2341	3,2383
(1) Datos preliminares					