

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

	06 Noviembre 17	07 Noviembre 17	08 Noviembre 17	09 Noviembre 17	10 Noviembre 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 909,4	5 447,0	5 382,0	6 268,1	5 529,9
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	74,0	208,0	157,0	200,0
Plazo de vencimiento	160,5	245,0	280,0	350,0	231,0
Tasas de inte Mínima	183 d	80 d	93 d	102 d	91 d
Máxima	3,50	3,49	3,48	3,51	3,48
Promedio	3,52	3,50	3,50	3,51	3,51
Saldo	33 810,9	33 297,9	33 742,9	33 072,1	33 372,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de noviembre de 2017	900,0		1 020,0		1 060,0
Vencimiento de CD BCRP del 13 al 17 de noviembre de 2017	1 920,0		1 020,0		1 060,0
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 13 al 17 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	1 700,0	1 200,0	900,0	900,0	900,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 17 de noviembre de 2017	500,0		100,0		100,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 13 al 17 de noviembre de 2017	900,0		0,0		100,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas		1 350,0	1 550,0	2 600,0	300,0
Plazo de vencimiento		1 704,7	1 704,7	2 736,6	854,0
Tasas de inte Mínima		1 d	1 d	1 d	7 d
Máxima		3,02	3,21	3,27	2,90
Promedio		3,50	3,45	3,50	3,34
Saldo		3,38	3,39	3,39	3,21
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 13 de noviembre 2017		1 350,0	1 550,0	2 600,0	2 500,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 13 al 17 de noviembre de 2017			1 550,0		2 200,0
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
Próximo vencimiento de Colo-TP el 19 de diciembre de 2017	200,0		200,0		200,0
Vencimiento de Colo-TP del 13 al 17 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 13 al 17 de noviembre de 2017	0,0		0,0		0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reoupar)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 225,1	11 225,1	11 225,1	11 225,1	11 100,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 17 de noviembre de 2017	125,0		125,0		500,0
Vencimiento de REPO del 13 al 17 de noviembre de 2017	0,0		0,0		500,0
viii. Compra con compromiso de Recompra 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 13 al 17 de noviembre de 2017	0,0		0,0		0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra 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 13 al 17 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 13 al 17 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 13 al 17 de noviembre de 2017	0,0		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	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					
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	3 805,4	3 710,0	3 387,0	3 337,9	2 729,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps):					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0108%	0,0108%	0,0108%	0,0108%	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	675,0	0,0	43,6	33,7	59,0
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	3 130,4	3 710,0	3 343,4	3 304,3	2 870,9
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 382,6	7 651,2	7 691,2	7 698,6	7 638,5
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,6	5,8	5,9	5,9	5,8
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 741,1	3 022,6	3 062,7	3 062,7	3 023,5
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,1	2,3	2,3	2,3	2,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 667,0	1 891,0	1 638,5	923,5	973,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,55/3,51	3,50/3,55/3,51	3,50/3,55/3,51	3,50/3,55/3,50	3,25/3,25/3,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	78,5	99,2	106,0	80,0	50,4
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	42,0	267,0	37,0	74,0	4,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	15,0 / 3,49				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	03 noviembre 17	06 noviembre 17	07 noviembre 17	08 noviembre 17	09 noviembre 17
Flujo de la posición global = a + b - c1 - e + f + g	50,5	-114,4	136,3	135,6	0,7
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	88,0	-32,3	102,4	128,6	36,3
a. Mercado spot con el público					
Compras	43,8	20,0	-47,1	36,1	41,3
ii (1) Ventas	205,5	186,6	214,0	267,7	318,6
b. Compra forward al público (con y sin entrega)					
L. Pactadas	189,3	40,5	151,1	149,5	340,7
ii (1) Ventas	36,7	21,3	62,1	89,5	501,2
c. Venta forward al público (con y sin entrega)					
L. Pactadas	127,4	104,8	52,3	57,5	-116,8
ii (1) Ventas	210,7	164,7	102,8	175,8	223,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
Al contado	23,3	59,9	59,3	118,3	340,4
ii. A futuro	447,0	177,5	347,3	315,0	413,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega					
Compras	50,0	0,0	15,0	3,0	66,0
ii (1) Ventas	-20,0	29,2	-16,9	26,5	-158,4
f. Efecto de Opciones	15,1	32,2	39,2	113,5	333,9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	35,2	3,0	55,1	87,1	483,4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	-0,7	0,5	-0,9	4,4	8,0
Tasa de interés	48,8	-9,0	153,3	92,9	-6,4
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datafact)	3,2450	3,2391	3,2414	3,2423	3,2450
(1) Datos preliminares					