

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	13 Noviembre 17		14 Noviembre 17		15 Noviembre 17		16 Noviembre 17		17 Noviembre 17	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	5 704,9		5 241,5		4 676,5		4 914,3		4 537,0	
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)	30,0	58,0	200,0	200,0	30,0	30,0	100,0	50,0	100,0	
Propuestas recibidas	103,0	59,0	358,0	389,0	65,0	75,2	240,7	128,0	221,0	
Plazo de vencimiento	183 d	87 d	183 d	182 d	540 d	357 d	89 d	31 d	97 d	
Tasas de Inter Mínima	3,25	3,29	3,30	3,30	3,35	3,35	3,22	3,21	3,30	
Máxima	3,31	3,35	3,32	3,35	3,39	3,36	3,32	3,28	3,32	
Promedio	3,30	3,32	3,31	3,33	3,36	3,35	3,30	3,26	3,31	
Saldo	33 660,1		33 860,1		33 890,1		32 960,1		33 110,1	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 05 de diciembre de 2017	1 060,0		1 060,0		1 060,0		1 200,0		1 200,0	
Vencimiento de CD BCRP del 20 al 24 de noviembre de 2017	1 060,0		1 060,0		1 060,0		0,0		0,0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de Inter Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	2 460,0		2 460,0		2 460,0		2 460,0		2 460,0	
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 18 de diciembre de 2017	200,0		200,0		200,0		200,0		200,0	
Vencimiento de REPO BCRP del 20 al 24 de noviembre 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 Inter Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	900,0		900,0		900,0		900,0		800,0	
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 12 de diciembre de 2017	100,0		100,0		100,0		100,0		200,0	
Vencimiento de CDLD BCRP del 20 al 24 de noviembre de 2017	100,0		100,0		100,0		0,0		0,0	
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	300,0	1900,0	360,6	2050,0	2 300,0	2 900,0	3 674,5	150,0	0,0	2600,0
Propuestas recibidas	740,0	3381,8	7,4	2695,1	2 730,0	1,4	394,0	3138,1	3,4	
Plazo de vencimiento	7 d	1 d	7 d	1 d	7 d	7 d	7 d	7 d	7 d	
Tasas de Inter Mínima	3,18	2,90	3,17	3,00	2,90	3,00	3,09	3,09	3,00	
Máxima	3,24	3,21	3,25	3,18	3,30	3,13	3,20	3,10	3,10	
Promedio	3,22	3,14	3,23	3,13	3,10	3,08	3,19	3,05	3,05	
Saldo	2 500,0		3 010,6		3 260,6		3 860,6		3 410,6	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 20 de noviembre de 2017	1 900,0		2 050,0		2 300,0		3 200,0		2 300,0	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 20 al 24 de noviembre de 2017	1 900,0		2 350,0		2 600,0		3 200,0		3 410,6	
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		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 20 al 24 de noviembre 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 Inter 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		0,0		0,0	
Vencimiento de CDR BCRP del 20 al 24 de noviembre 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 Inter Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	11 100,1		11 100,1		11 100,1		11 100,1		10 600,1	
Próximo vencimiento de Repo Regular el 27 de noviembre de 2017	500,0		500,0		500,0		500,0		900,0	
Vencimiento de REPO del 20 al 24 de noviembre de 2017	500,0		500,0		500,0		500,0		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		4 050,0	
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 16 de Marzo de 2018	500,0		500,0		500,0		500,0		500,0	
Vencimiento de REPO Expansión del 20 al 24 de noviembre 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 Inter 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 20 al 24 de noviembre 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 Inter Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	0,0		0,0		0,0		0,0		0,0	
Próximo vencimiento de SC-Venta el	0,0		0,0		0,0		0,0		0,0	
Vencimiento de SC - Venta del 20 al 24 de noviembre de 2017	0,0		0,0		0,0		0,0		0,0	
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		0,0	
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0		0,0		0,0		0,0		0,0	
Vencimiento de SC - Compra del 20 al 24 de noviembre de 2017	0,0		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										
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	3 216,9		2 630,9		2 346,5		1 884,3		1 637,0	
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)										
Tasa de interés	4,30%		4,30%		4,30%		4,30%		4,30%	
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés	1 040,3		383,7		202,0		209,7		208,7	
Depósitos Overnight en moneda nacional	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	2 176,6		2 247,2		2 144,6		1 674,5		1 428,3	
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	7 491,6		7 638,0		7 552,6		7 493,4		7 431,1	
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,7		5,8		5,7		5,7		5,8	
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 988,5		2 998,5		2 870,8		2 739,5		2 743,6	
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,3		2,3		2,2		2,1		2,1	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional										
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,25/3,25/3,25		3,25/3,25/3,25		3,25/3,25/3,25		3,20/3,25/3,24		3,00/3,25/3,21	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)										
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	76,0		80,0		84,0		84,0		10,0	
c. Total mercado secundario de CDBCRP - CDBCRP-NR y CDV	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	
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)	25,0		0,0		0,0		0,0		10,0	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)									10,0/3,33	
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)										
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	10 noviembre 17		13 noviembre 17		14 noviembre 17		15 noviembre 17		16 noviembre 17	
Flujo de la posición global = a + b + (-c) + e + f + g	-66,2		59,7		-66,7		-61,5		88,6	
Flujo de la posición contable = a + b + (-c) + e + g	-89,3		20,9		80,1		63,7		19,5	
a. Mercado spot con el público	-28,0		40,4		91,1		81,9		63,2	
i. Compras	206,3		349,8		329,8		329,8		258,8	
ii (-) Ventas	234,3		309,4		254,7		254,7		185,7	
b. Operaciones forward al público (con y sin entrega)	-7,1		-60,5		-123,7		-141,1		-141,1	
i. Pactadas	107,2		34,5		75,8		321,9		126,3	
ii (-) Vencidas	100,1		95,0		199,5		167,5		267,4	
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-3,3		-99,7		27,6		-217,5		-217,5	
i. Pactadas	58,7		118,2		400,3		152,2		152,2	
ii (-) Vencidas	67,0		168,5		90,5		123,7		372,8	
d. Operaciones cambiarias interbancarias	285,8		-122,5		363,1		665,8		458,0	
i. Al contado	21,5		10,0		30,0		1,0		34,0	
ii. A futuro	-94,5		62,7		-122,2		-70,6		62,6	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	3,3		132,7		65,2		94,8		275,0	
i. Compras	97,8		80,1		187,4		165,4		212,4	
ii (-) Ventas	94,5		147,6		122,2		170,6		240,4	
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	7,8		-0,3		4,6		-3,0		-2,2	
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	0,0		-1,7		2,3		8,6		-0,9	
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2421		3,2414		3,2420		3,2507		3,2511	
(*) Datos preliminares										