

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	27 Noviembre 17	28 Noviembre 17	29 Noviembre 17	30 Noviembre 17	01 Diciembre 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 876,5	2 213,2	2 498,4	2 514,4	1 078,1
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 BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	30,0		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	70,0		100,0	100,0	
Tasas de inter Mínima	169 d		554 d	371 d	
Máxima	3,33		3,35	3,37	
Promedio	3,33		3,39	3,40	
Saldo	3,33		3,37	3,38	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 04 de diciembre de 2017	33 587,1	33 587,1	33 617,1	33 647,1	33 647,1
Vencimiento de REPO BCRP del 04 al 07 de diciembre de 2017	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0
0,0	0,0	0,0	0,0	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	4 610,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 04 de diciembre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	2 150,0
Vencimiento de REPO BCRP del 04 al 07 de diciembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	2 150,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas			200,0	100,0	
Plazo de vencimiento			380,0	155,0	
Tasas de inter Mínima			61 d	61 d	
Máxima			3,19	3,24	
Promedio			3,30	3,28	
Saldo	800,0	800,0	1 200,0	1 200,0	1 200,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 12 diciembre, 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 04 al 07 de diciembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 100,3	1 498,9	1 240,6	1 310,0	
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	
Tasas de inter Mínima	3,00	3,00	3,05	3,00	
Máxima	3,18	3,24	3,25	3,25	
Promedio	3,11	3,13	3,15	3,14	
Saldo	1 032,3	1 350,0	1 240,6	1 310,0	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 30 de noviembre 2017	1 032,3	1 350,0	1 240,6	1 310,0	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 04 al 07 de diciembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	
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 04 al 07 de diciembre 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 04 al 07 de diciembre 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	9 700,1	9 700,1	9 700,1	9 700,1	9 100,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 07 de diciembre de 2017	600,0	600,0	600,0	600,0	200,0
Vencimiento de REPO del 04 al 07 de diciembre de 2017	600,0	600,0	600,0	600,0	200,0
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 04 al 07 de diciembre 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 04 al 07 de diciembre 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					
Vencimiento de SC - Venta del 04 al 07 de diciembre de 2017					
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					
Vencimiento de SC - Compra del 04 al 07 de diciembre de 2017					
xii. 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					
Vencimiento de SC - Compra del 04 al 07 de diciembre de 2017					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio		3,2330	3,2330	3,2330	3,2325
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				200,00	200,00
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	1 096,5	882,6	1 340,9	1 203,5	3 263,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0109%	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%	3,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	264,8	128,2	423,9	368,6	50,4
Tasa de interés	2,00%	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					
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	6 761,1	6 812,8	6 711,3	6 668,0	7 832,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,1	5,2	5,1	5,2	5,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 199,4	2 298,7	2 112,9	2 063,3	3 213,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,7	1,6	1,6	2,5
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	3,25/3,25/3,25	79,0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	1,25/1,25/1,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	70,0	59,1	180,1	175,0	70,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		50,0 / 3,34			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			9,5 / 3,34		
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	24 noviembre 17	27 noviembre 17	28 noviembre 17	29 noviembre 17	30 noviembre 17
Flujo de la posición global = a + b) - c) + e + f + g	-1,7	109,1	-16,3	41,0	42,4
Flujo de la posición contable = a + b) - c) + e + f + g	-20,7	-20,6	-130,5	-133,6	137,2
a. Mercado spot con el público					
i. Compras	259,6	276,0	242,1	325,4	419,2
ii (-) Ventas	223,8	257,7	307,2	307,2	271,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-64,2	174,7	-50,6	63,3	1,5
i. Pacifadas	21,3	245,9	208,0	228,2	258,1
ii (-) Vencidas	85,5	71,2	256,6	164,8	256,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-85,4	46,0	-180,7	-109,1	94,3
i. Pacifadas	44,4	98,6	43,4	137,4	321,8
ii (-) Vencidas	129,8	52,8	224,1	246,5	227,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	152,0	323,5	579,0	611,9	357,0
ii. A futuro	0,0	3,0	6,0	6,0	119,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-15,3	-47,7	-54,6	-101,2	-32,9
i. Compras	66,0	27,8	17,2	24,3	167,8
ii (-) Ventas	81,3	64,5	231,8	140,1	220,6
f. Efecto de Operaciones	-2,2	1,0	4,1	2,2	-1,9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	3,1	3,1	-3,1	-171,3	-7,0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2370	3,2366	3,2354	3,2330	3,2337
(*) Datos preliminares					