

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	11 Diciembre 17	12 Diciembre 17	13 Diciembre 17	14 Diciembre 17	15 Diciembre 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 291.2	4 512.4	4 832.9	5 332.0	3 825.5
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	100.0	30.0	100.0	200.0
Plazo de vencimiento	213.9	524.5	192.0	638.0	430.0
Tasas de inter Minima	178.4	86.4	540.4	357.4	83.4
Máxima	3.27	3.19	3.31	3.18	3.00
Promedio	3.30	3.25	3.33	3.20	3.15
Saldo	3.29	3.23	3.32	3.20	3.11
Próximo vencimiento de CD BCRP el 18 de diciembre de 2017	31 289.9	30 179.0	30 324.0	30 489.0	30 689.0
Vencimiento de CD BCRP del 18 al 22 de diciembre de 2017	1 160.9	200.0	200.0	200.0	50.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1 360.9	200.0	200.0	200.0	50.0
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Minima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 459.9	2 459.9	2 459.9	2 459.9	2 459.9
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 18 al 22 de diciembre de 2017					
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Minima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 000.0	1 000.0	1 000.0	1 000.0	1 000.0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 19 diciembre, 2017	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de CDLD BCRP del 18 al 22 de diciembre de 2017	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas		1 500.0	2 200.0	3 000.0	2 222.8
Plazo de vencimiento		3 115.7	3 237.0	3 293.4	2 222.8
Tasas de inter Minima		1.4	1.4	1.4	3.4
Máxima		2.95	2.87	2.85	2.83
Promedio		3.07	3.22	3.01	3.24
Saldo		3.03	2.98	2.99	2.99
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 18 de diciembre de 2017		1 500.0	2 200.0	3 000.0	2 222.8
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 18 al 22 de diciembre de 2017			2 200.0	2 200.0	2 222.8
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Minima					
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 18 al 22 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					300.0
Plazo de vencimiento					790.0
Tasas de inter Minima					62
Máxima					-1.50
Promedio					-0.50
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	-0.83
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 15 febrero 2018	0.0	0.0	0.0	0.0	835.0
Vencimiento de CDR BCRP del 18 al 22 de diciembre de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	835.0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Minima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	8 900.1	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	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de REPO del 18 al 22 de diciembre de 2017	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Minima					
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 18 al 22 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 Minima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 730.0	3 730.0	3 730.0	3 730.0	3 730.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 26 de enero de 2018	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de REPO Sustitucion del 18 al 22 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 Minima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 18 de diciembre de 2017					
Vencimiento de SC - Venta del 18 al 22 de diciembre de 2017					
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Minima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Compra el 18 de diciembre de 2017					
Vencimiento de SC - Compra del 18 al 22 de diciembre de 2017					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
Saldo	5.0	5.0	5.0	5.0	5.0
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
Saldo	3 232.0	3 232.0	3 232.0	3 232.0	3 232.0
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	200.00	200.00	200.00	200.00	200.00
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					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 261.2	2 912.4	2 519.1	2 018.2	1 402.7
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%	0.0108%	0.0108%
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					
Depósitos Overnight en moneda nacional	1 423.6	816.7	504.1	335.9	114.8
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	1 837.6	2 095.7	2 015.0	1 682.3	1 287.9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8 099.0	8 097.9	8 118.6	7 967.7	7 868.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.1	6.1	6.1	6.0	5.9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 484.9	3 534.8	3 417.8	3 307.2	3 172.5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.6	2.6	2.6	2.5	2.4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 433.0	1 670.0	979.0	521.0	1 081.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3.25/3.25/3.25	3.25/3.25/3.25	3.25/3.25/3.25	3.10/3.25/3.21	3.25/3.25/3.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	28.0	26.0	26.0	46.0	29.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1.25/1.25/1.25	1.25/1.25/1.25	1.25/1.25/1.25	1.50/1.50/1.50	1.50/1.50/1.50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	200.0	0.0	0.0	25.9	0.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				22.7 / 3.20	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	07 diciembre 17	11 diciembre 17	12 diciembre 17	13 diciembre 17	14 diciembre 17
Flujo de la posición global = a + b) - c) + e + f + g	124.0	3.0	88.6	-118.3	104.9
Flujo de la posición contable = a + b) - c) + e + f + g	-5.3	73.6	216.0	-47.8	221.9
a. Mercado spot con el público	20.9	130.7	130.7	-100.5	231.1
i. Compras	274.8	379.2	348.7	337.0	479.7
ii (-) Ventas	253.9	246.4	228.1	437.4	249.6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	51.5	-3.3	-43.7	113.4	-221.6
i. Pacifadas	108.6	286.1	153.7	253.9	96.4
ii (-) Vencidas	57.1	289.4	110.0	140.6	316.0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-67.2	64.6	172.3	-181.8	-111.2
i. Pacifadas	169.3	292.4	332.8	306.1	326.2
ii (-) Vencidas	236.5	227.6	160.5	124.3	437.4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	360.0	208.0	366.5	283.0	558.0
ii. A futuro	28.0	45.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	158.8	-109.0	37.0	19.7	139.5
i. Compras	212.7	172.9	132.0	113.0	421.9
ii (-) Ventas	53.9	281.9	95.0	93.3	282.3
f. Efecto de Operaciones	10.6	-0.7	-0.7	-2.1	-6.8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-5.5	-11.8	110.8	16.8	-26.4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datastat)	3.2357	3.2354	3.2336	3.2321	3.2423
(*) Datos preliminares					