

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	18 Diciembre 17	19 Diciembre 17	20 Diciembre 17	21 Diciembre 17	22 Diciembre 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 297,3	2 446,6	1 711,4	663,5	-110,6
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)	30,0		30,0	30,0	
Propuestas recibidas	191,0		201,0	130,2	
Plazo de vencimiento	171 d		533 d	350 d	
Tasas de Inter Mínima	3,10		3,1	3,05	
Máxima	3,10		3,1	3,10	
Promedio	3,10		3,1	3,10	
Saldo	30 669,0	30 669,0	30 714,0	30 747,2	30 747,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 26 de diciembre de 2017	60,0		60,0	60,0	60,0
Vencimiento de REPO BCRP del 26 al 29 de diciembre de 2017	0,0		0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				300,0	1200
Propuestas recibidas			1000,0	3105	2520,0
Plazo de vencimiento			1 d	1 d	4 d
Tasas de Inter Mínima			3,51	3,62	3,56
Máxima			3,51	3,69	3,62
Promedio			3,51	3,61	3,59
Saldo	2 259,9	2 259,9	2 259,9	3 759,9	4 709,9
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 26 de diciembre de 2017	150,0		150,0		2 450,0
Vencimiento de REPO BCRP del 26 al 29 de diciembre de 2017	0,0		0,0		2 450,0
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	1 000,0	800,0	800,0	800,0	400,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 22 diciembre, 2017	200,0		400,0		
Vencimiento de CDLD BCRP del 20 al 29 de diciembre de 2017	200,0		400,0		
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	1 033,9	700,1	322,4		
Propuestas recibidas	1 033,9	1 236,9	322,4		
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d		
Tasas de Inter Mínima	2,97	2,81	2,90		
Máxima	3,24	3,05	3,15		
Promedio	3,05	2,91	3,01		
Saldo	1 033,9	700,1	322,4		
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 21 de diciembre de 2017	1 033,9		322,4		
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 26 al 29 de diciembre de 2017	1 033,9		322,4		
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	1 800,0	1 800,0	1 500,0	1 500,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 26 de diciembre de 2017	200,0		300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 26 al 29 de diciembre de 2017	500,0		300,0		
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	835,0	835,0	835,0	835,0	835,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 15 febrero 2018	835,0		835,0		835,0
Vencimiento de CDR BCRP del 26 al 29 de diciembre de 2017	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	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
Vencimiento de REPO del 26 al 29 de diciembre de 2017	0,0		0,0		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
Vencimiento de REPO Expansión del 26 al 29 de diciembre 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 Inter Mínima					
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
Vencimiento de REPO Sustitucion del 26 al 29 de diciembre de 2017	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 26 de enero de 2018					
Vencimiento de SC - Venta del 26 al 29 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 el 26 de enero de 2018					
Vencimiento de SC - Compra del 26 al 29 de diciembre de 2017					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
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					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2 233,4	1 746,5	1 359,0	2 133,5	2 339,4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0107%	0,0108%	0,0107%	0,0108%	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	10,0	250,2	33,5	4,7	425,0
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	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	2 223,4	1 496,3	1 325,0	2 128,7	1 914,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 658,3	7 724,8	7 497,7	7 355,6	7 322,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,7	5,7	5,6	5,5	5,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 925,9	2 820,1	2 745,4	2 653,0	2 619,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,2	2,2	2,0	2,0	1,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 464,0	805,0	1 122,0	890,0	620,9
Tasas de Inter: Mínima / Máxima / Promedio	3,25/3,25/3,25	3,25/3,25/3,25	3,25/3,25/3,25	3,25/3,50/3,32	3,25/3,50/3,32
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	25,0	21,5	5,0	10,0	7,0
Tasas de Inter: Mínima / Máxima / Promedio	1,50/1,50/1,50	1,50/1,50/1,50	1,50/1,50/1,50	1,50/1,50/1,50	1,50/1,50/1,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	60,0	195,0	30,0	40,0	23,9
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\$)	15 diciembre 17	18 diciembre 17	19 diciembre 17	20 diciembre 17	21 diciembre 17
Flujo de la posición global = a + b) - c) + e + f + g	29,4	-161,6	-175,0	-128,0	55,5
Flujo de la posición contable = a + b) - c) + e + f + g	390,4	78,1	69,8	141,7	2,3
a. Mercado spot con el público	196,2	98,5	33,9	172,9	366,4
i. Compras	441,2	438,1	428,0	438,1	366,4
ii (-) Ventas	245,0	339,6	394,1	296,2	342,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	62,6	-367,3	-55,3	-75,0	-18,8
i. Pacifadas	103,2	115,8	111,6	168,4	116,9
ii (-) Vencidas	40,6	483,1	166,9	243,3	135,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	413,0	-135,0	196,5	-63,8	-73,4
i. Pacifadas	487,1	133,5	322,7	114,9	182,0
ii (-) Vencidas	73,9	268,5	126,2	178,7	255,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	604,5	546,2	734,8	553,8	699,0
ii. A futuro	9,0	28,0	9,0	0,0	3,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	11,8	-229,0	-69,9	-88,3	96,6
i. Compras	43,5	198,7	92,1	199,2	230,4
ii (-) Ventas	31,6	427,7	161,9	227,5	133,7
f. Efecto de Opciones	-10,3	-7,4	7,1	-2,6	-1,5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	263,6	-6,8	65,1	-7,5	1,9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datastat)	3,2638	3,2900	3,2667	3,2748	3,2665
(*) Datos preliminares					