BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	03 Enero 18			04 Enero 18		05 Enero 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**480,5**			**1 951,1**		**2 724,9**
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		30,0		
Propuestas recibidas		184,0		255,0		
Plazo de vencimiento		554 d		371 d		
Tasas de inter Mínima		3,10		3,07		
Máxima		3,10		3,08		
Promedio		3,10		3,07		
Saldo		30 777,2		30 750,0		30 750,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 09 de enero de 2018		60,0		1 159,0		1 159,0
Vencimiento de CD BCRP del 08 al 12 de enero de 2018		60,0		0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1000,0	1000,0	2250,0	1 600,0		1 300,0
Propuestas recibidas	2450,0	2390,0	4115,0	1 600,0		1 300,0
Plazo de vencimiento	1 d	7 d	1 d	1 d		3 d
Tasas de inter Mínima	3,32	3,28	3,25	3,25		3,25
Máxima	3,36	3,36	3,41	3,27		3,25
Promedio	3,33	3,29	3,30	3,25		3,25
Saldo		7 359,9		5 209,9		4 409,9
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 8 de enero de 2018		3 750,0		2 100,0		1 300,0
Vencimiento de REPO BCRP del 08 al 12 de enero de 2018		4 250,0		2 100,0		2 300,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)				500,0	728,0	
Propuestas recibidas				1191,0	748,0	
Plazo de vencimiento				60 d	61 d	
Tasas de inter Mínima				2,90	2,93	
Máxima				3,05	3,10	
Promedio				2,98	3,03	
Saldo		400,0		1 628,0		1 628,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 29 enero, 2018		400,0		400,0		400,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 08 al 12 de enero de 2018				0,0		0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de inter Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo						
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el						
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 08 al 12 de enero de 2018						
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de inter Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo		1 200,0		1 200,0		1 200,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de junio de 2018		300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 08 al 12 de enero de 2018						
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
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 15 febrero 2018		835,0		835,0		835,0
Vencimiento de CDR BCRP del 08 al 12 de enero de 2018		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		8 600,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 12 de enero de 2018		300.0		300.0		300.0
Vencimiento de REPO del 08 al 12 de enero de 2018		300,0		300,0		300,0
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
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 16 de Marzo de 2018		500,0		500,0		500,0
Vencimiento de REPO Expansión del 08 al 12 de enero de 2018		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
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 26 de enero de 2018		200,0		200,0		200,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 08 al 12 de enero de 2018		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
Próximo vencimiento de SC-Venta el						
Vencimiento de SC - Venta del 08 al 12 de enero de 2018						
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
Próximo vencimiento de SC-Compra		0,0		0,0		0,0
Vencimiento de SC - Compra del 08 al 12 de enero de 2018		0,0		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR		29,0		349,6		0,0
i. Compras (millones de US$)		9,0		109,0		
Tipo de cambio promedio		3,2180		3,2077		
ii. Ventas (millones de US$)						
Tipo de cambio promedio						
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US$)		1 869,79				
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público		1 869,79				
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público						
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP						
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR						
ii. Compras de BTP						
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 729.4**			**3 870.7**		**4 024.9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones						
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).						
Comisión (tasa efectiva diaria)		0,0109%		0,0110%		0,0108%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)						
Tasa de interés		3,80%		3,80%		3,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional						
Tasa de interés						
d. Depósitos Overnight en moneda nacional		0,0		19,6		107,5
Tasa de interés		2,00%		2,00%		2,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**4 729,4**			**3 851,2**		**3 917,4**
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)		7 089.0		7 435.7		7 379.6
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)		5,4		5,6		5,5
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)		2 365,8		2 705,9		2 676,1
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)		1,8		2,1		2,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP						
a. Operaciones a la vista en moneda nacional		882,0		1 967,0		1 052,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		3,25/3,25/3,25		3,25/3,25/3,25		3,25/3,25/3,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)		25,0		63,0		31,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio		1,50/1,50/1,50		1,50/1,50/1,50		1,50/1,55/1,51
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV		2,0		50,0		25,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)						
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)						
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)				30,0 / 3,10		
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**02 enero 18**			**03 enero 18**		**04 enero 18**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g		-0,4		-79,2		-51,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g		5,7		-94,8		-542,3
a. Mercado spot con el publico		-0,7		-28,5		-37,5
i. Compras		75,4		259,4		243,2
ii (-) Ventas		76,1		287,9		280,6
b. Compras forward al publico (con y sin entrega)		-22,5		119,1		373,9
i. Pactadas		0,0		215,6		596,4
ii (-) Vencidas		22,5		96,5		222,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)		-16,5		108,6		-115,5
i. Pactadas		0,0		370,2		156,5
ii (-) Vencidas		16,5		261,6		272,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias						
i. Al contado		0,0		544,9		712,7
ii. A futuro		0,0		23,0		8,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega		0,4		124,7		45,4
i. Compras		15,5		206,1		264,5
ii (-) Ventas		15,0		81,4		219,2
f. Efecto de Opciones		-0,2		5,1		1,3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras		0,0		-25,9		-500,6
h. Credito por regulacion monetaria en moneda extranjera						
Tasa de interés						
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)		3,2405		3,2274		3,2067
(*) Datos preliminares						

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera