

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	18 Setiembre 17	19 Setiembre 17	20 Setiembre 17	21 Setiembre 17	22 Setiembre 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	7 121,5	7 048,1	5 494,6	3 958,8	3 172,5
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)	30,0 98,0 183 d 3,50 Máxima Promedio Saldo	230,0 522,0 265,0 115,0 215,0 3,50 3,50 3,50 3,50 31 627,7 200,0 0,0	135,0 450,0 250,0 3,50 3,50 3,50 3,50 3,50 3,50 3,50 3,50 3,50 3,50	30,0 200,0 565,0 105,0 100,0 3,50 3,50 3,50 3,50 32 422,7 200,0 0,0	30,0 100,0 346,0 196 d 3,50 3,50 3,52 3,51
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	Prouestas recibidas Plazo de vencimiento Tasas de Inter Mínima Máxima Promedio Saldo	2 460,0 200,0 0,0 100,0 170,0 60 d 3,44 3,50 3,45 2 195,0 200,0 0,0	2 460,0 200,0 0,0 100,0 170,0 60 d 3,44 3,50 3,46 2 195,0 200,0 0,0	2 460,0 200,0 0,0 100,0 170,0 60 d 3,44 3,50 3,44 2 195,0 200,0 0,0	2 460,0 200,0 0,0 100,0 170,0 60 d 3,44 3,50 3,45 2 195,0 200,0 0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)	Prouestas recibidas Plazo de vencimiento Tasas de Inter Mínima Máxima Promedio Saldo	473,0 3020,0 7 d 3,35 3,50 3,48 3,48 6 258,3 5 785,3 6 258,3	250,0 2535,3 1 d 3,01 3,50 3,48 3,48 5 332,8 4 609,8 4 609,8	1609,9 1614,4 1 d 3,16 3,50 3,45 3,45 4 562,5 3 839,5 3 839,5	1339,5 1350,0 1 d 3,03 3,50 3,49 3 191,0 2 468,0 2 468,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	Prouestas recibidas Plazo de vencimiento Tasas de Inter Mínima Máxima Promedio Saldo	583,0 3020,0 7 d 3,35 3,50 3,48 3,48 6 258,3 5 785,3 6 258,3	250,0 2535,3 1 d 3,01 3,50 3,48 3,48 5 332,8 4 609,8 4 609,8	1609,9 1614,4 1 d 3,16 3,50 3,45 3,45 4 562,5 3 839,5 3 839,5	1339,5 1350,0 1 d 3,03 3,50 3,49 3 191,0 2 468,0 2 468,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público	Prouestas recibidas Plazo de vencimiento Tasas de Inter Mínima Máxima Promedio Saldo	2 000,0 200,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	2 000,0 200,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	2 000,0 200,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	2 000,0 200,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	Prouestas recibidas Plazo de vencimiento Tasas de Inter Mínima Máxima Promedio Saldo	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	Prouestas recibidas Plazo de vencimiento Tasas de Inter Mínima Máxima Promedio Saldo	11 833,1 20,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	11 833,1 20,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	11 833,1 20,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	11 833,1 20,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)	Prouestas recibidas Plazo de vencimiento Tasas de Inter Mínima Máxima Promedio Saldo	4 050,0 20,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	4 050,0 20,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	4 050,0 20,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	4 050,0 20,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)	Prouestas recibidas Plazo de vencimiento Tasas de Inter Mínima Máxima Promedio Saldo	3 730,0 200,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	3 730,0 200,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	3 730,0 200,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	3 730,0 200,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	Prouestas recibidas Plazo de vencimiento Tasas de Inter Mínima Máxima Promedio Saldo	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP	Prouestas recibidas Plazo de vencimiento Tasas de Inter Mínima Máxima Promedio Saldo	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
xii. Compra de SC - Compra del 25 al 29 de setiembre de 2017	Prouestas recibidas Plazo de vencimiento Tasas de Inter Mínima Máxima Promedio Saldo	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
xiii. Compra de SC - Venta del 25 al 29 de setiembre de 2017	Prouestas recibidas Plazo de vencimiento Tasas de Inter Mínima Máxima Promedio Saldo	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
xiv. Compra de SC - Compra del 25 al 29 de setiembre de 2017	Prouestas recibidas Plazo de vencimiento Tasas de Inter Mínima Máxima Promedio Saldo	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0	0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0 0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR	i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	3,2	0,0
	ii. Ventas (millones de US\$)	0,0	0,0	1,0	0,0
	iii. Tipo de cambio promedio			3,2450	
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	54,1	54,1	54,1	54,1
	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	1 238,2	1 603,3	863,3	1 360,8	1 272,6
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%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	Tasa de interés	59,5	171,5	27,0	167,0
	Tasa de interés	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	Tasa de interés	59,5	171,5	27,0	167,0
	Tasa de interés	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	1 178,7	1 431,8	836,3	1 255,8	1 105,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 217,9	7 348,7	7 038,5	7 043,4	6 947,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,7	5,8	5,6	5,6	5,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 650,9	2 749,9	2 471,6	2 439,2	2 358,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,1	2,2	2,0	1,9	1,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	587,0	487,0	1 161,0	910,8	1 049,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	87,5	144,5	178,5	388,3	163,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,70/3,50/3,22	3,00/2,5/3,20	3,25/3,25/3,25	2,00/3,25/3,23	1,70/2,30/2,23
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	684,4	631,5	542,5	35,0	260,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	255,0 / 3,51	43,0 / 3,52	118,4 / 3,58	10,0 / 3,52	130,0 / 3,40
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 setiembre 17	18 setiembre 17	19 setiembre 17	20 setiembre 17	20 setiembre 17
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	41,9	-156,6	145,1	119,8	119,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f + g	245,1	171,4	150,6	28,8	28,8
a. Mercado swap con el público	217,0	152,2	197,1	61,7	61,7
i. Compras	473,8	473,8	473,8	379,3	379,3
ii. (-) Ventas	256,8	321,6	276,7	317,6	317,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-87,3	-513,6	-62,2	113,8	113,8
i. Pactadas	153,7	198,2	137,6	235,2	235,2
ii. (-) Ventas	250,9	611,8	219,8	121,4	121,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	69,7	-91,6	-75,1	23,3	23,3
i. Pactadas	249,4	140,4	268,5	170,3	170,3
ii. (-) Ventas	149,7	332,0	343,6	147,0	147,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	592,2	606,0	613,0	497,8	497,8
ii. A futuro	52,0	37,0	48,0	3,0	3,0
e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	72,1	-294,0	87,7	-2,7	-2,7
i. Compras	127,2	318,3	290,4	116,2	116,2
ii. (-) Ventas	155,3	191,6	202,8	118,9	118,9
f. Efecto de Opciones	-6,2	0,0	1,6	0,5	0,5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-1,0	-34,6	-10,3	-4,5	-4,5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2480	3,2480	3,2440	3,2451	3,2451
(*) Datos preliminares					