

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**  
(Millones de Soles)

|  | 15 Enero 18        | 16 Enero 18        | 17 Enero 18        | 18 Enero 18        | 19 Enero 18        |
|--|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| <b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>         | <b>6 682,9</b>     | <b>5 895,2</b>     | <b>5 060,5</b>     | <b>4 220,6</b>     | <b>2 886,1</b>     |
| <b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>                      |                    |                    |                    |                    |                    |
| <b>a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR</b>  |                    |                    |                    |                    |                    |
| i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Propuestas recibidas   | 30,0               | 350,0              | 350,0              | 100,0              |                    |
| Plazo de vencimiento   | 296,5              | 1355,5             | 1663,5             | 670,5              |                    |
| Tasas de interés Mínima  | 173,0              | 87,0               | 173,0              | 360,0              |                    |
| Máxima   | 2,60               | 2,60               | 2,62               | 2,65               |                    |
| Promedio   | 2,65               | 2,68               | 2,70               | 2,75               |                    |
| Saldo  | 2,64               | 2,64               | 2,67               | 2,73               |                    |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 25 de enero de 2018  | 29 306,8           | 30 128,8           | 31 071,8           | 31 126,8           | 31 126,8           |
| Vencimiento de CD BCRP del 22 al 26 de enero de 2018   | 100,0              | 250,0              | 250,0              | 234,0              | 234,0              |
| ii. Subasta de Comera Temporal de Valores (REPO)   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Propuestas recibidas   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Plazo de vencimiento   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Tasas de interés Mínima  |                    |                    |                    |                    |                    |
| Máxima   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Promedio   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Saldo  | 2 109,9            | 2 109,9            | 2 109,9            | 2 109,9            | 2 109,9            |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 4 de junio de 2018   | 300,0              | 300,0              | 300,0              | 300,0              | 300,0              |
| Vencimiento de REPO BCRP del 22 al 26 de enero de 2018   | 0,0                | 0,0                | 0,0                | 0,0                | 0,0                |
| iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)                      |                    |                    |                    |                    |                    |
| Propuestas recibidas   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Plazo de vencimiento   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Tasas de interés Mínima  |                    |                    |                    |                    |                    |
| Máxima   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Promedio   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Saldo  | 1 628,0            | 1 628,0            | 1 628,0            | 1 628,0            | 1 628,0            |
| Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 29 enero, 2018   | 400,0              | 400,0              | 400,0              | 400,0              | 400,0              |
| Vencimiento de CDLD BCRP del 22 al 26 de enero de 2018   | 0,0                | 0,0                | 0,0                | 0,0                | 0,0                |
| iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional  |                    |                    |                    |                    |                    |
| Propuestas recibidas   | 1499,9             | 2200,0             | 1500,0             | 827,9              | 500,0              |
| Plazo de vencimiento   | 2081,0             | 2243,4             | 1500,1             | 827,9              | 1500,0             |
| Tasas de interés Mínima  | 1 d                | 1 d                | 1 d                | 1 d                | 1 d                |
| Máxima   | 2,95               | 3,00               | 2,98               | 2,97               | 2,95               |
| Promedio   | 2,92               | 2,91               | 2,94               | 2,96               | 2,94               |
| Saldo  | 3 699,9            | 3 000,1            | 3 327,9            | 2 000,0            | 1 100,1            |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 22 de enero de 2018  | 3 699,9            | 3 000,1            | 3 327,9            | 2 000,0            | 1 100,1            |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo el 22 al 26 de enero de 2018  | 3 699,9            | 3 000,1            | 3 327,9            | 2 000,0            | 1 100,1            |
| v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Propuestas recibidas   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Plazo de vencimiento   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Tasas de interés Mínima  |                    |                    |                    |                    |                    |
| Máxima   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Promedio   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Saldo  | 1 200,0            | 1 200,0            | 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              | 300,0              | 300,0              |
| Vencimiento de Coloc-TP del 22 al 26 de enero de 2018  |                    |                    |                    |                    |                    |
| vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reposables del BCRP (ICDR BCRP)                                   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Propuestas recibidas   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Plazo de vencimiento   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Tasas de interés 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              | 835,0              | 835,0              |
| Vencimiento de CDR BCRP del 22 al 26 de enero de 2018  | 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 interés Mínima  |                    |                    |                    |                    |                    |
| Máxima   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Promedio   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Saldo  | 8 300,1            | 8 300,1            | 8 300,1            | 8 300,1            | 8 300,1            |
| Próximo vencimiento de Repo Regular el 09 de marzo de 2018   | 300,0              | 300,0              | 300,0              | 300,0              | 300,0              |
| Vencimiento de REPO del 22 al 26 de enero de 2018  | 300,0              | 300,0              | 300,0              | 300,0              | 300,0              |
| viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)                                   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Propuestas recibidas   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Plazo de vencimiento   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Tasas de interés 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 22 al 26 de enero de 2018  | 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 interés 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 22 al 26 de enero de 2018  | 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 interés Mínima  |                    |                    |                    |                    |                    |
| Máxima   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Promedio   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Saldo  | 0,0                | 0,0                | 0,0                | 0,0                | 0,0                |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 22 de enero de 2018   |                    |                    |                    |                    |                    |
| xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP  |                    |                    |                    |                    |                    |
| Propuestas recibidas   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Plazo de vencimiento   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Tasas de interés Mínima  |                    |                    |                    |                    |                    |
| Máxima   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Promedio   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Saldo  | 0,0                | 0,0                | 0,0                | 0,0                | 0,0                |
| Próximo vencimiento de SC-Compra el 22 de enero de 2018  |                    |                    |                    |                    |                    |
| xii. Compra de Swap Cambiario Comera del BCRP  |                    |                    |                    |                    |                    |
| Propuestas recibidas   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Plazo de vencimiento   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Tasas de interés Mínima  |                    |                    |                    |                    |                    |
| Máxima   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Promedio   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Saldo  | 0,0                | 0,0                | 0,0                | 0,0                | 0,0                |
| Próximo vencimiento de SC-Comera el 22 de enero de 2018  |                    |                    |                    |                    |                    |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR  |                    |                    |                    |                    |                    |
| i. Compras (millones de US\$)  | 112,4              | 99,5               | 0,0                | 0,0                | 0,0                |
| ii. Ventas (millones de US\$)  | 35,0               | 31,0               | 0,0                | 0,0                | 0,0                |
| iii. Tipo de cambio promedio   | 3,2100             | 3,2100             |                    |                    |                    |
| 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   |                    |                    |                    |                    |                    |
| <b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b> | <b>2 224,4</b>     | <b>2 072,6</b>     | <b>1 789,6</b>     | <b>1 915,6</b>     | <b>1 786,0</b>     |
| <b>4. Operaciones monetarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>                                   |                    |                    |                    |                    |                    |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swasta)   |                    |                    |                    |                    |                    |
| Comisión (tasa efectiva diaria)  | 0,0110%            | 0,0110%            | 0,0110%            | 0,0109%            | 0,0099%            |
| 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 revaluación monetaria en moneda nacional  |                    |                    |                    |                    |                    |
| Tasa de interés  | 73,9               | 143,6              | 55,4               | 74,2               | 204,1              |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional  |                    |                    |                    |                    |                    |
| Tasa de interés  | 2,00%              | 2,00%              | 2,00%              | 1,75%              | 1,75%              |
| <b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>        | <b>2 150,5</b>     | <b>1 929,1</b>     | <b>1 841,4</b>     | <b>1 841,4</b>     | <b>1 581,8</b>     |
| f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)*                                | 7 351,4            | 7 351,4            | 7 351,4            | 7 351,4            | 7 351,4            |
| g. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)                                 | 5,8                | 5,7                | 5,7                | 5,7                | 5,6                |
| h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)                                    | 3 101,3            | 3 131,4            | 2 876,2            | 2 920,0            | 2 840,1            |
| i. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)                                    | 2,3                | 2,3                | 2,2                | 2,2                | 2,1                |
| <b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>   |                    |                    |                    |                    |                    |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional   | 217,0              | 415,0              | 888,0              | 718,0              | 579,0              |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)  | 3 003,00/3,00      | 3 003,00/3,00      | 3 003,00/3,00      | 3 003,00/3,00      | 3 003,00/3,00      |
| c. Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio  | 70,0               | 22,0               | 84,0               | 52,0               | 47,0               |
| d. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV   | 1,50/1,55/1,51     | 1,50/1,55/1,50     | 1,50/1,50/1,50     | 1,50/1,50/1,50     | 1,50/1,50/1,50     |
| e. Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)   | 177,2              | 159,4              | 132,5              | 145,0              | 0,0                |
| f. Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)  | 127,2 / 2,70       | 9,4 / 2,70         |                    | 120,0 / 2,65       |                    |
| <b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>                    | <b>12 enero 18</b> | <b>15 enero 18</b> | <b>16 enero 18</b> | <b>17 enero 18</b> | <b>18 enero 18</b> |
| Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g  | 41,1               | 74,9               | -36,2              | 27,7               | -42,5              |
| Flujo de la posición contable = a + b + c - d + e + f + g  | -10,8              | -22,2              | 31,6               | 82,0               | 86,9               |
| a. Mercado spot con el público   | 8,8                | 46,7               | 71,0               | 75,3               | 75,3               |
| i. Compras   | 253,3              | 296,1              | 290,3              | 317,3              | 317,3              |
| ii. (i) Ventas   | 244,4              | 191,4              | 246,7              | 238,0              | 238,1              |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega)  | 66,3               | 20,2               | -66,8              | -260,6             | -376,3             |
| i. Pactadas  | 154,5              | 56,1               | 71,4               | 81,1               | 64,7               |
| ii. (i) Ventadas   | 88,2               | 37,8               | 138,2              | 343,7              | 441,0              |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega)   | 10,1               | -76,9              | -203,9             | -246,9             | -246,5             |
| i. Pactadas  | 194,2              | 30,7               | 117,5              | 227,1              | 344,2              |
| ii. (i) Ventadas   | 184,0              | 108,7              | 186,7              | 190,2              | 190,8              |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias   |                    |                    |                    |                    |                    |
| i. Al contado  | 711,0              | 560,5              | 357,9              | 629,9              | 915,4              |
| ii. A futuro   | 50,0               | 0,0                | 0,0                | 27,0               | 30,0               |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega                               |                    |                    |                    |                    |                    |
| i. Compras   | 75,4               | 66,7               | 66,7               | 56,7               | 157,3              |
| ii. Ventas   | 154,1              | 129,2              | 129,2              | 129,2              | 154,1              |
| f. Efecto de opciones  | 78,7               | 34,5               | 126,7              | 408,7              | 408,7              |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras   | 0,1                | 0,9                | -0,8               | 0,2                | 0,2                |
| h. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera  | -4,2               | -34,6              | -32,5              | -1,2               | 0,1                |
| Tasa de interés  |                    |                    |                    |                    |                    |
| <b>Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)</b>                                       | <b>3,2180</b>      | <b>3,2102</b>      | <b>3,2105</b>      | <b>3,2110</b>      | <b>3,2123</b>      |