

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	12 Febrero 18	13 Febrero 18	14 Febrero 18	15 Febrero 18	16 Febrero 18											
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	6 955,4	7 824,8	6 601,7	5 778,1	4 487,2											
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones																
a. Operaciones monetarias anuales del BCR																
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	50,0 178 d 2,68 2,69 2,69	150,0 365 d 2,69 2,69 2,69	300,0 162 d 2,67 2,69 2,69	150,0 177 d 2,67 2,70 2,69	190,0 359 d 2,69 2,70 2,72	183,0 388,0 541 d 2,71 2,73	50,0 540 d 2,69 2,70 2,70	213,0 540 d 2,69 2,70 2,70	313,5 358 d 2,68 2,69 2,70	200,0 176 d 2,68 2,69 2,69	50,0 362 d 2,70 2,70 2,70	150,0 539 d 2,70 2,70 2,70	150,0 362 d 2,69 2,70 2,69	210,0 182 d 2,68 2,70 2,69	150,0 381 d 2,70 2,70 2,70	240,0 181 d 2,67 2,69 2,69
Saldo	32 007,8	31 551,5	32 328,0	32 888,0	33 278,0											
Próximo vencimiento de CD BCRP el 22 de febrero de 2018	1 090,0	300,0	300,0	300,0	300,0											
Vencimiento de CD BCRP del 19 al 23 de febrero de 2018	1 090,0	0,0	0,0	0,0	300,0											
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)																
Propuestas recibidas																
Plazo de vencimiento																
Tasas de interés Mínima																
Máxima																
Promedio																
Saldo	2 108,9	2 108,9	2 108,9	2 108,9	2 108,9											
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 19 al 23 de febrero 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	1 228,0	1 228,0	1 228,0	1 228,0	1 228,0											
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 05 marzo 2018	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0											
Vencimiento de CDLD BCRP del 19 al 23 de febrero de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0											
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	2000,0 3070,0	0,0 1871,0	2292,0 5082,0	2046,8 2046,8	1905,0 1562,9	1500,0 1562,9	1556,4 1562,9	1500,0 1031,0	1475,0 1475,0	1000,0 1000,0	300,0 300,0	1000,0 1000,0	899,9 899,9			
Propuestas recibidas																
Plazo de vencimiento																
Tasas de interés Mínima																
Máxima																
Promedio																
Saldo	4 471,0	5 138,0	4 338,2	4 783,6	4 002,2											
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 19 de febrero de 2018	4 171,0	4 338,2	4 338,2	4 363,4	2 199,9											
Vencimiento de Depósitos a Plazo el 19 al 23 de febrero de 2018	4 171,0	4 338,2	4 338,2	4 363,4	2 199,9											
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 19 al 23 de febrero de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0											
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)																
Propuestas recibidas																
Plazo de vencimiento																
Tasas de interés Mínima																
Máxima																
Promedio																
Saldo	2 492,0	2 692,0	2 722,0	1 887,0	1 887,0											
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 06 abril 2018	835,0	835,0	835,0	835,0	110,0											
Vencimiento de CDR BCRP del 19 al 23 de febrero de 2018	835,0	835,0	835,0	835,0	0,0											
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resulan)																
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 19 al 23 de febrero de 2018	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 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 19 al 23 de febrero 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	3 530,0	3 530,0	3 530,0	3 530,0	3 530,0											
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 20 de abril de 2018	150,0	150,0	150,0	150,0	150,0											
Vencimiento de REPO Sustitución del 19 al 23 de febrero 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	500,0	700,0	900,0	900,0	900,0											
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 abril de 2018	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0											
Vencimiento de SC - Venta del 19 al 23 de febrero de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0											
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0											
Vencimiento de SC - Compra del 19 al 23 de febrero de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0											
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	2 284,4	2 262,8	1 631,8	1 745,0	1 697,3											
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%	0,0098%											
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	3,05%	4,03%	14,0%	18,0%	227,0											
d. Depósitos Overnights en moneda nacional	305,0	403,0	14,0%	18,0%	227,0											
Tasa de interés	1,75%	1,75%	1,75%	1,75%	1,75%											
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 979,4	1 859,8	1 817,8	1 939,0	1 670,3											
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	7 949,2	8 045,5	7 911,5	7 770,8	10 394,4											
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,8	5,8	5,7	5,7	7,5											
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 092,4	3 119,0	3 026,0	2 870,0	5 507,1											
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,3	2,3	2,2	2,1	4,0											
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CD BCRP																
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 596,0	1 250,0	1 551,0	1 278,5	1 491,0											
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,003/3,053/3,01	3,003/3,003/3,00	3,003/3,003/3,00	3,003/3,053/3,01	3,003/3,053/3,01											
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	214,0	209,0	159,0	202,0	202,0											
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,50 / 1,55 / 1,50	1,50 / 1,55 / 1,51	1,50 / 1,55 / 1,50	1,50 / 1,55 / 1,51	1,50 / 1,55 / 1,51											
c. Total mercado secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y CDV	30,0	0,0	0,0	149,5	105,0											
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\$)	09 Febrero 18	12 Febrero 18	13 Febrero 18	14 Febrero 18	15 Febrero 18											
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	41,9	-98,8	-27,6	118,3	-86,5											
Flujo de la posición comercial = a + b - c + e + f + g	216,1	-142,8	-247,8	34,1	-252,2											
a. Mercado spot con el público	26,7	-120,5	-287,9	-25,7	-9,3											
Compras	297,8	179,8	179,8	254,2	314,3											
i. () Ventas	260,9	352,1	467,7	279,9	323,6											
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	74,7	47,7	152,0	109,7	208,1											
i. () Pacadas	101,7	146,2	221,9	326,0	326,0											
ii. () Ventadas	27,0	96,5	69,9	216,3	120,3											
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	347,0	347,0	347,0	18,3	31,6											
i. () Pacadas	367,7	367,7	367,7	371,6	371,6											
ii. () Ventadas	20,6	80,7	80,7	256,2	340,0											
d. Operaciones cambiarias interbancarias																
i. Al contado	528,7	611,0	845,0	964,6	870,9											
ii. A futuro	29,0	3,0	5,0	5,0	65,0											
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	4,8	4,2	4,2	39,6	227,7											
i. Compras	13,6	65,1	67,2	253,2	336,0											
ii. Ventas	-8,8	60,9	63,0	213,6	168,3											
f. Efecto de Opciones	-0,7	-0,3	1,7	-0,2	-7,8											
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	288,7	-4,2	123,2	86,0	-256,8											
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera																
Tasa de interés																
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2702	3,2640	3,2697	3,2674	3,2473											
(*) Bases preliminar																