

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

	26 Febrero 18	27 Febrero 18	28 Febrero 18	01 Marzo 18	02 Marzo 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 741,7	4 494,2	3 992,4	2 820,8	2 799,9
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias asociadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	50,0	200,0	200,0	50,0	50,0
Plazo de vencimiento	201,5	498,5	627,5	712,0	507,5
Tasas de interés Mínima	171 d	28 d	170 d	350 d	28 d
Máxima	2,7	2,60	2,67	2,69	2,69
Promedio	2,7	2,81	2,69	2,69	2,70
Saldo	33 206,3	2,76	2,67	2,69	2,69
Próximo vencimiento de CD BCRP el 06 de marzo de 2018	1 429,1			34 110,3	34 160,3
Vencimiento de CD BCRP del 05 al 09 de marzo de 2018	0,0			1 429,1	1 429,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	300,0			700,0	1 500,0
Plazo de vencimiento	1 d			1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	3,00			3,05	3,00
Máxima	3,00			3,05	3,05
Promedio	3,00			3,05	3,03
Saldo	2 400,9	2 109,9	2 109,9	2 809,9	3 609,9
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 05 de marzo de 2018	300,0			300,0	500,0
Vencimiento de REPO BCRP del 05 al 09 de marzo de 2018	300,0			0,0	1 500,0
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 de marzo de 2018	500,0			500,0	500,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 05 al 09 de marzo de 2018	0,0			0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	2 984,0	2 803,0	1 905,0	1 975,1	1 975,1
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de interés Mínima	2,8	2,82	2,85	2,75	2,75
Máxima	2,9	2,98	2,96	3,00	3,00
Promedio	2,9	2,87	2,92	2,89	2,89
Saldo	3 000,0	2 803,0	2 875,1	2 875,1	2 875,1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 05 de marzo de 2018	3 000,0			2 875,1	2 875,1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 05 al 09 de marzo de 2018	3 000,0			2 875,1	2 875,1
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
Vencimiento de Coloc-TP del 05 al 09 de marzo de 2018	300,0			300,0	300,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 887,0	1 887,0	1 887,0	1 887,0	1 887,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 06 de abril de 2018	110,0			110,0	110,0
Vencimiento de CDR BCRP del 05 al 09 de marzo de 2018	0,0			0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reoulán)					
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
Vencimiento de REPO del 05 al 09 de marzo 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 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
Vencimiento de REPO Expansión del 05 al 09 de marzo 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 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
Vencimiento de REPO Sustitución del 05 al 09 de marzo de 2018	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	900,0	900,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 de abril de 2018	500,0			500,0	500,0
Vencimiento de SC - Venta del 05 al 09 de marzo de 2018	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 05 al 09 de marzo de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipos de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipos 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 v 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	1 491,7	1 036,2	767,3	3 470,8	4 299,9
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	580,5	477,5	260,3	300,0	605,9
d. Depósitos Overnights en moneda nacional	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	7 059,7	558,8	6 976,4	3 178,8	3 694,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	5,1	5,1	5,1	5,1	5,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2 206,0	2 202,5	2 141,9	2 083,2	2 888,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	1,6	1,6	1,6	2,1	2,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)					
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CD BCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 396,0			1 406,5	1 163,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,00/3,05/3,01	1 525,2	1 510,5	3,00/3,05/3,00	2,75/3,05/3,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	56,5	3,00/3,05/3,00	98,5	98,5	125,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,50 / 1,55 / 1,50	135,5	96,9	1,50 / 1,55 / 1,50	1,50 / 1,55 / 1,50
c. Total mercado secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR v CDV	0,0	1,50 / 1,55 / 1,52	145,0	200,5	151,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		29,0	105,0 / 2,67	100,0 / 2,69	65,0 / 2,69
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		156,2	35,0 / 2,69		
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	23 Febrero 18	26 Febrero 18	27 Febrero 18	28 Febrero 18	01 Marzo 18
Flujo de la posición global a = b + c + e + f + g	15,3	70,8	-47,2	80,8	-33,3
Flujo de la posición contable = a + b + c - d + e + g	-27,7	0,8	120,0	-20,0	-59,9
a. Mercado spot con el público	219,7	294,3	294,3	294,3	294,3
Compras	247,4	283,6	239,8	360,5	316,4
i. (i) Ventas	85,7	-231,7	-133,8	149,8	67,4
b. Compras forward al público (con y sin entrada)	123,8	139,8	161,1	137,3	137,3
i. (i) Ventadas	38,1	371,1	214,8	114,6	69,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrada)	12,6	-124,4	-128,4	92,3	57,0
i. (i) Pactadas	178,8	183,3	289,4	184,6	174,1
ii. (ii) Ventadas	116,2	462,6	150,0	74,3	117,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	676,1	601,0	737,8	819,8	796,2
ii. A futuro	0,0	10,0	1,0	17,0	2,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrada	91,9	85,8	47,7	89,4	89,4
i. Compras	105,2	447,3	151,5	80,7	116,6
ii. Ventas	13,3	261,5	203,7	86,5	49,4
f. Efecto de Opciones	-0,1	8,7	-14,3	-0,7	1,5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-1,8	-0,7	2,7	88,3	-4,4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2490	3,2493	3,2497	3,2612	3,2639
(*) Bases prefinanciadas					