

**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				
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>7 121,5</b>	<b>7 048,1</b>	<b>5 494,6</b>	<b>3 958,8</b>	<b>3 172,5</b>				
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>									
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	230,0 522,0 265,0 115,0 235,0 3,50 3,50 3,50 31 042,7 200,0 0,0	135,0 215,0 357 d 3,50 3,50 3,51	450,0 600,0 182 d 3,50 3,50 3,50 32 422,7 200,0 0,0	30,0 200,0 565,0 30,0 100,0 355 d 3,51 3,51 32 552,7 200,0 0,0	100,0 346,0 196 d 3,50 3,52 3,51 32 552,7 200,0 0,0			
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento	183 d	358 d	357 d	85 d	197 d				
Tasas de Inter Mínima	3,50	3,50	3,50	3,50	3,51				
Máxima	3,50	3,50	3,52	3,50	3,52				
Promedio	3,50	3,50	3,51	3,50	3,51				
Saldo	2 460,0	2 460,0	2 460,0	2 460,0	2 460,0				
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 18 de diciembre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0				
Vencimiento de REPO BCRP del 25 al 29 de setiembre de 2017	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	170,0	60 d	3,44	3,50	3,45				
Tasas de Inter Mínima	3,44	3,50	3,45	3,44	3,45				
Máxima	3,44	3,50	3,45	3,44	3,45				
Promedio	3,44	3,50	3,45	3,44	3,45				
Saldo	2 195,0	2 195,0	2 195,0	2 195,0	2 195,0				
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 23 octubre, 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0				
Vencimiento de CDLD BCRP del 25 al 29 de setiembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	473,0 583,0 7 d 3,35 3,50 3,48	250,0 2535,3 1 d 3,01 3,50 3,41	250,0 3028,6 7 d 3,01 3,48 3,48	1609,9 1614,4 1 d 3,16 3,50 3,45	2500,0 1339,5 1 d 3,35 3,50 3,44	1350,0 1118,0 1 d 3,03 3,50 3,49	1118,0 1534,4 1 d 3,00 3,50 3,36	999,9 1031,0 3 d 2,97 3,50 3,40	900,0 1031,0 3 d 2,97 3,50 3,40
Saldo	6 258,3	6 258,3	6 258,3	4 562,5	3 191,0				
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 25 de setiembre de 2017	5 785,3	4 609,8	4 609,8	3 839,5	2 468,0				
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 25 al 29 de setiembre de 2017	6 258,3	4 609,8	4 609,8	3 839,5	2 468,0				
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0				
Tasas de Inter Mínima	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0				
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Saldo	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0				
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 19 de diciembre de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0				
Vencimiento de Coloc-TP del 25 al 29 de setiembre de 2017	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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Tasas de Inter Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Vencimiento de CDR BCRP del 25 al 29 de setiembre de 2017	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	583,0	583,0	583,0	583,0	583,0				
Tasas de Inter Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Saldo	11 833,1	11 833,1	11 833,1	11 833,1	11 833,1				
Próximo vencimiento de Repo Regular el 03 de octubre de 2017	20,0	20,0	20,0	20,0	20,0				
Vencimiento de Repo Regular del 25 al 29 de setiembre de 2017	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	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0				
Tasas de Inter Mínima	20,0	20,0	20,0	20,0	20,0				
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Saldo	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0	4 050,0				
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 03 de octubre de 2017	20,0	20,0	20,0	20,0	20,0				
Vencimiento de Repo Expansión del 25 al 29 de setiembre de 2017	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	3 730,0	3 730,0	3 730,0	3 730,0	3 730,0				
Tasas de Inter Mínima	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0				
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
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 25 al 29 de setiembre de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Tasas de Inter Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Próximo vencimiento de SC-Venta el									
Vencimiento de SC - Venta del 25 al 29 de setiembre de 2017									
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Tasas de Inter Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0				
Próximo vencimiento de SC-Compra									
Vencimiento de SC - Compra del 25 al 29 de setiembre de 2017									
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR									
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	3,2	1,0	0,0				
Tipo de cambio promedio			3,2450						
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	54,1	54,1	54,1	54,1	54,1				
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>1 238,2</b>	<b>1 603,3</b>	<b>863,3</b>	<b>1 360,8</b>	<b>1 272,6</b>				
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>									
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)									
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0108%	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%	4,30%				
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional									
Tasa de interés	59,5	171,5	27,0	105,0	167,0				
Depósitos Overnight en moneda nacional	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%				
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>1 178,7</b>	<b>1 431,8</b>	<b>836,3</b>	<b>1 255,8</b>	<b>1 105,6</b>				
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				
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>									
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	388,3	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	663,3	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)									
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>15 setiembre 17</b>	<b>18 setiembre 17</b>	<b>19 setiembre 17</b>	<b>20 setiembre 17</b>	<b>20 setiembre 17</b>				
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 + 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	324,7	324,7	316,6	316,6				
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-97,3	-513,6	-62,2	113,8	113,8				
i. Pactadas	153,7	198,2	137,6	235,2	235,2				
ii. (-) Ventas	250,9	619,8	219,6	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	817,7	-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									
<b>Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)</b>	<b>3,2480</b>	<b>3,2480</b>	<b>3,2440</b>	<b>3,2451</b>	<b>3,2451</b>				
(*) Datos preliminares									