

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

	22 Enero 18	23 Enero 18	24 Enero 18	25 Enero 18	26 Enero 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 242,5	2 076,7	2 022,0	2 846,1	2 890,7
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)					
Propuestas recibidas	30,0		30,0	30,0	100,0
Plazo de vencimiento	191,0		174,0	174,0	361,0
Tasas de interés Mínima	178,4		533,0	350,0	81,0
Máxima	2,7		2,69	2,72	2,69
Promedio	2,7		2,72	2,70	2,72
Saldo	31 156,8	31 156,8	31 156,8	30 982,8	31 236,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 06 de febrero de 2018	234,0		234,0		1 430,0
Vencimiento de CD BCRP del 29 de enero al 02 de febrero de 2018	234,0		234,0		0,0
ii. Subasta de Compra 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
Vencimiento de REPO BCRP del 29 de enero al 02 de febrero de 2018	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 de enero de 2018	400,0		400,0		400,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 29 de enero al 02 de febrero de 2018	0,0		0,0		0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	500,0	500,0	700,0	1 300,0	1 212,9
Plazo de vencimiento	985,2	895,2	1 207,5	1 816,5	1 212,9
Tasas de interés Mínima	1,0	1,0	1,0	1,0	3,0
Máxima	2,7	2,7	2,66	2,55	2,55
Promedio	2,8	2,8	2,75	2,78	3,00
Saldo	500,0	500,0	700,0	1 300,0	1 212,9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 29 de enero 2018	500,0		700,0		300,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 29 de enero al 02 de febrero de 2018	500,0		700,0		1 212,9
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
Vencimiento de Coloc-TP del 29 de enero al 02 de febrero de 2018					
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reposables del BCRP (CDR 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
Vencimiento de CDR BCRP del 29 de enero al 02 de febrero de 2018	0,0		0,0		0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Requirit)					
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 29 de enero al 02 de febrero de 2018	300,0		300,0		300,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Excepción)					
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 Excepción el 16 de marzo de 2018	500,0		500,0		500,0
Vencimiento de REPO Excepción del 29 de enero al 02 de febrero 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	3 730,0	3 730,0	3 730,0	3 730,0	3 530,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 20 de abril de 2018	200,0		200,0		150,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 29 de enero al 02 de febrero 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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 02 de febrero de 2018					
Vencimiento de SC - Venta del 29 de enero al 02 de febrero 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					
Vencimiento de SC - Compra del 29 de enero al 02 de febrero de 2018					
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	1 712,5	1 576,7	1 292,0	1 516,1	1 364,3
4. Operaciones monetarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0110%	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 reposición monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	228,0	174,6	181,1	160,6	285,9
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	1,484%	1,482%	1,110%	1,355%	1,078%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 484,6	1 482,1	1 110,9	1 355,5	1 078,4
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)*	745,4	745,3	745,1	745,1	745,6
g. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,5	5,5	5,4	5,3	5,3
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 873,2	2 815,5	2 552,8	2 502,3	2 447,5
i. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	2,0	1,9	1,9	1,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 536,0	1 413,5	1 750,0	821,5	1 283,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	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
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	132,5	225,0	30,0	70,0	0,5
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	80,0 / 2,65		30,0 / 2,73	60,0 / 2,72	
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	19 enero 18	22 enero 18	23 enero 18	24 enero 18	25 enero 18
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	103,0	-36,3	-54,0	-107,0	-137,4
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	37,2	-10,0	-20,1	-38,4	-120,7
a. Mercado spot con el público	50,3	-6,0	-6,8	-23,3	-112,7
i. Compras	349,0	178,7	255,9	281,1	274,0
ii. Ventas	298,7	284,7	261,7	284,4	386,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	82,1	94,8	55,6	101,7	117,7
i. Facturas	84,0	146,2	72,9	190,7	197,5
ii. Facturas	1,9	51,4	4,3	140,8	315,2
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	84,3	26,4	68,4	58,7	58,7
i. Facturas	84,3	102,8	288,8	170,8	285,7
ii. Facturas	89,1	76,4	180,4	111,5	384,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	347,2	316,3	428,8	474,0	879,1
ii. A futuro	0,0	5,0	22,0	1,0	49,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	56,8	3,1	150,1	-30,0	35,5
f. Compras	57,5	160,1	168,0	168,0	351,9
g. Efecto de Opciones	0,8	47,1	1,0	137,0	312,4
h. Crédito por reposición monetaria en moneda extranjera	-1,2	3,3	0,3	2,3	2,3
Tasa de interés	-2,5	-1,1	1,6	-4,3	1,8
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2189	3,2141	3,2180	3,2122	3,2091