

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	5 Febrero 18	6 Febrero 18	7 Febrero 18	8 Febrero 18	9 Febrero 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 145,3	4 696,8	4 071,5	5 235,5	7 862,5
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	100,0	408,0	127,5	100,0
Plazo de vencimiento	177,3	522,0	1296,5	211,5	399,9
Tasas de Inicie Mínima	195,4	366,4	163,4	547,4	162,4
Máxima	2,55	2,69	2,67	2,70	2,68
Promedio	2,71	2,71	2,70	2,69	2,69
Saldo	32 440,3	31 568,3	32 170,7	31 038,2	31 597,8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de febrero de 2018	1 430,0	1 761,1	1 761,1	1 080,0	0,0
Vencimiento de CD BCRP del 12 al 16 de febrero de 2018	3 191,1	1 761,1	1 761,1	0,0	0,0
ii. Subasta de Certificados de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	700,0				
Plazo de vencimiento	1 200,3				
Tasas de Inicie Mínima	1,0				
Máxima	3,06				
Promedio	3,06				
Saldo	2 809,9	2 109,9	2 109,9	2 109,9	2 109,9
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 4 de junio de 2018	700,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO BCRP del 12 al 16 de febrero de 2018	700,0	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 Inicie 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 12 al 16 de febrero de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas		400,0	300,0	500,0	1500,0
Plazo de vencimiento		289,2	897,4	1769,0	1124,1
Tasas de Inicie Mínima		1,0	1,0	1,0	3,0
Máxima		2,61	2,83	2,52	2,49
Promedio		2,92	2,93	2,65	2,59
Saldo		2,84	2,87	2,58	2,71
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 12 de febrero 2017					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 12 al 16 de febrero de 2018					
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inicie 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 12 al 16 de febrero de 2018					
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reastables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas			212,0	300,0	390,0
Plazo de vencimiento			662,0	470,0	620,0
Tasas de Inicie Mínima			61,0	61,0	61,0
Máxima			0,20	0,50	0,07
Promedio			0,70	0,69	0,40
Saldo	835,0	945,0	1 457,0	2 102,0	2 492,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 15 febrero 2018	835,0	835,0	835,0	835,0	835,0
Vencimiento de CDR BCRP del 12 al 16 de febrero 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 Inicie 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 12 al 16 de febrero de 2018					
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inicie 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 12 al 16 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 Inicie 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 12 al 16 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 Inicie Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 abril de 2018					
Vencimiento de SC - Venta del 12 al 16 de febrero de 2018					
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inicie Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra					
Vencimiento de SC - Compra del 12 al 16 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 v BTP					
i. Compras de CD BCRP v 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	3 815,3	3 188,8	2 782,1	2 967,5	2 857,6
a. Compra temporal de moneda extranjera (Iniciada)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0099%	0,0099%	0,0108%	0,0108%	0,0097%
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	158,6	199,9	340,3	30,0	14,5
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1,75%	1,75%	1,75%	1,75%	1,75%
4. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 556,7	2 988,9	2 441,8	2 937,5	2 843,1
f Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 412,0	8 280,1	8 256,8	8 119,5	8 111,5
f Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEI)	6,1	6,1	6,0	5,9	5,9
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 558,5	3 443,1	3 400,9	3 271,5	3 266,3
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEI)	2,6	2,5	2,5	2,4	2,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDB/CRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 041,0	1 876,5	1 756,5	1 473,5	1 625,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,00/3,00/3,00	3,00/3,05/3,01	3,00/3,05/3,01	3,00/3,05/3,01	3,00/3,00/3,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	1,50 / 1,55/ 1,50	1,50 / 1,50/ 1,50	1,50 / 1,55/ 1,50	1,50 / 1,55/ 1,50	1,50 / 1,50/ 1,50
c. Total mercado secundario de CDB/CRP, CDB/CRP-NR v CDV					
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\$)	02 Febrero 18	05 Febrero 18	06 Febrero 18	07 Febrero 18	08 Febrero 18
Flujo de la posición global = g + b.i - c.i + e + f + d	83,4	-8,3	-137,8	120,5	13,6
Flujo de la posición contable = a + b.i - c.i + e + d	49,3	-89,7	-32,8	89,9	142,6
a. Mercado spot con el público	54,1	-43,7	-49,2	-61,4	-69,6
i. Compras	252,7	242,1	279,0	292,5	329,7
ii. Ventas	188,6	305,8	347,2	343,9	398,5
b. Operaciones forward al público (con y sin entrega)	88,9	127,3	101,7	101,7	-113,7
i. Pacadas	100,8	178,4	486,1	172,2	120,0
ii. (c) Vencidas	11,9	49,9	405,8	70,5	233,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	73,3	31,3	165,5	74,7	33,0
i. Pacadas	156,6	87,9	236,2	136,7	445,4
ii. (c) Vencidas	83,3	56,6	70,7	56,0	415,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	915,7	535,4	724,5	747,2	780,5
ii. A futuro	20,0	106,0	30,0	8,0	32,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	54,1	-61,0	-30,2	-20,2	200,5
i. Compras	71,7	33,5	65,4	46,4	406,5
ii. (c) Ventas	10,7	43,7	46,0	66,6	206,0
f. Efecto de Operaciones	-1,5	2,1	-19,9	4,5	17,7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	5,5	-10,4	36,0	160,1	192,7
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2178	3,2254	3,2511	3,2461	3,2537
(*) Datos preliminares.					