

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

	19 Febrero 18	20 Febrero 18	21 Febrero 18	22 Febrero 18	23 Febrero 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 798,4	3 891,8	3 020,9	3 422,5	2 948,3
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		50,0	50,0	
Plazo de vencimiento	231,0		185,0	179,0	
Tasas de interés Mínima	178 d		533 d	355 d	
Máxima	2,7		2,7	2,69	
Promedio	2,7		2,8	2,69	
Saldo	33 328,0	33 328,0	33 309,9	33 155,3	33 155,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 06 de marzo de 2018	300,0		300,0		
Vencimiento de CD BCRP del 26 de febrero al 02 de marzo de 2018	300,0		300,0		
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas				300,0	300,0
Plazo de vencimiento				1 d	3 d
Tasas de interés Mínima				3,15	3,23
Máxima				3,15	3,23
Promedio				3,15	3,23
Saldo	2 109,9	2 109,9	2 109,9	2 409,9	2 709,9
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 26 de febrero de 2018	300,0		300,0		600,0
Vencimiento de REPO BCRP del 26 de febrero al 02 de marzo de 2018	0,0		0,0		600,0
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
Vencimiento de CDLD BCRP del 26 de febrero al 02 de marzo de 2018	0,0		0,0		0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	300,1	1900,0	1 800,0	2 000,0	1 999,9
Plazo de vencimiento	891,9	2020,1	954,0	2 396,8	3 105,6
Tasas de interés Mínima	7 d	1 d	7 d	1 d	3 d
Máxima	2,92	2,87	2,94	2,84	2,78
Promedio	3,00	3,00	2,98	2,99	2,94
Saldo	2,99	2,95	2,99	2,91	2,88
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 28 de febrero 2018	4 000,3		3 500,1	3 100,0	2 800,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 26 de febrero al 02 de marzo de 2018	2 400,2	4 100,1	2 400,1		2 300,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público	3 400,3		2 800,3		2 800,0
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 26 de febrero al 02 de marzo de 2018					
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 abril 2018	110,0		110,0		110,0
Vencimiento de CDR BCRP del 26 de febrero al 02 de marzo de 2018	0,0		0,0		0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Rescat)					
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 26 de febrero al 02 de marzo de 2018					
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 26 de febrero al 02 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 26 de febrero al 02 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	900,0	900,0	900,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 abril de 2018	500,0		500,0		500,0
Vencimiento de SC - Venta del 26 de febrero al 02 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
Vencimiento de SC - Compra del 26 de febrero al 02 de marzo de 2018	0,0		0,0		0,0
xii. Compra con compromiso de Recompra del BCR					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	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	1 548,3	1 391,8	1 070,9	1 672,5	1 548,4
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	118,0	284,0	93,8	222,8	61,4
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	1 430,3	1 107,8	917,9	1 449,7	1 487,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	9 836,5	10 077,4	7 338,7	7 289,9	7 176,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,1	7,3	5,3	5,2	5,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 965,3	2 545,1	2 402,5	2 402,0	2 362,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,6	3,8	1,8	1,8	1,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CD BCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	116,0	1 096,0	1 487,0	1 522,0	1 733,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,003 / 0,003 / 0,00	3,003 / 0,003 / 0,00	3,003 / 0,003 / 0,01	3,003 / 0,003 / 0,01	3,003 / 0,003 / 0,01
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	202,0	252,5	165,0	185,0	185,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,50 / 1,55 / 1,51	1,50 / 1,55 / 1,51	1,50 / 1,55 / 1,50	1,50 / 1,55 / 1,50	1,50 / 1,55 / 1,51
c. Total mercado secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y 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\$)	16 Febrero 18	19 Febrero 18	20 Febrero 18	21 Febrero 18	22 Febrero 18
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	-62,3	76,3	26,8	-157,7	51,3
Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + f + g	-110,4	51,0	-25,3	-110,9	-33,7
a. Mercado spot con el público	-106,6	56,1	-22,7	-119,8	-49,7
i. Compras	237,9	241,2	271,7	217,8	280,5
ii. Ventas	344,5	186,1	294,4	337,6	330,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	181,4	41,9	-44,0	112,9	-6,8
i. Pactadas	242,2	42,3	172,2	162,1	196,8
ii. Vencidas	80,8	3,3	216,2	79,6	246,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	111,6	23,4	-26,2	164,6	-160,2
i. Pactadas	172,5	152,8	228,0	228,0	225,5
ii. Vencidas	60,9	39,9	266,9	63,5	385,7
c. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	109,3	512,2	484,0	773,2	824,3
ii. A futuro	0,0	46,0	46,0	0,0	11,2
d. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-30,0	-34,8	-1,8	-14,8	143,3
i. Compras	-42,5	35,2	238,4	62,5	382,8
ii. Ventas	72,5	69,9	284,4	77,3	239,5
e. Efecto de Opciones	-1,7	6,8	-1,1	5,2	-5,4
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	6,5	-3,3	-3,7	-5,4	-8,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2418	3,2496	3,2525	3,2475	3,2502
(*) Bases prefinancias					