

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**  
(Millones de Soles)

	28 Mayo 18	29 Mayo 18	30 Mayo 18	31 Mayo 18	01 Junio 18
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>872,5</b>	<b>1 005,1</b>	<b>1 526,7</b>	<b>393,9</b>	<b>1 024,2</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)					
Propuestas recibidas	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Plazo de vencimiento	205,0	210,0	154,0	154,0	154,0
Tasas de Inté Miríma	171,4	528,4	345,4	345,4	345,4
Máxima	2,57	2,75	2,75	2,88	2,87
Promedio	2,66	2,75	2,75	2,87	2,81
Saldo	2,61	2,75	2,75	2,82	2,75
Próximo vencimiento de CD BCRP el 07 de junio de 2018	26 894,4	26 894,4	26 944,4	27 019,4	27 019,4
Vencimiento de CD BCRP del 04 al 08 de junio de 2018	904,9	904,9	904,9	904,9	904,9
0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
300,0	300,0	400,0	300,0	750,0	1500,0
500,0	301,0	301,0	723,0	1365,0	3545,0
1 d	1 d	7 d	1 d	3 d	3 d
2,88	2,93	3,08	3,10	2,93	2,87
3,03	2,93	3,16	3,22	3,05	2,96
Promedio	2,97	3,12	3,16	2,99	2,92
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 04 de junio de 2018	3 108,9	3 108,9	3 209,9	4 259,9	7 509,8
Vencimiento de REPO BCRP del 04 al 08 de junio de 2018	300,0	300,0	300,0	750,0	4 299,9
300,0	300,0	0,0	750,0	750,0	5 149,9
ii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inté Miríma					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 04 al 08 de junio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inté Miríma					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 04 al 08 de junio de 2018					
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inté Miríma					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 000,0	3 000,0	3 000,0	3 000,0	3 000,0
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 04 al 08 de junio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inté Miríma					
Máxima					
Promedio					
Saldo	510,0	510,0	510,0	510,0	510,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 09 de julio, 2018	510,0	510,0	510,0	510,0	510,0
Vencimiento de CDR BCRP del 04 al 08 de junio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recupera de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inté Miríma					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 283,1	5 283,1	5 283,1	5 283,1	5 283,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 13 de junio de 2018	300,0	300,0	300,0	300,0	225,0
Vencimiento de REPO del 04 al 08 de junio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recupera de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inté Miríma					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 14 de Setiembre de 2018	800,0	800,0	800,0	800,0	800,0
Vencimiento de REPO Expansión del 04 al 08 de junio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recupera de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inté Miríma					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 300,0	2 300,0	2 300,0	2 300,0	2 300,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 24 de agosto de 2018	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 04 al 08 de junio de 2018					
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inté Miríma					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 260,1	1 260,1	1 260,1	1 260,1	1 260,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 03 julio 2018	400,1	400,1	400,1	400,1	400,1
Vencimiento de SC - Venta del 04 al 08 de junio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inté Miríma					
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 04 al 08 de junio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación 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					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>1 122,5</b>	<b>1 305,1</b>	<b>1 476,7</b>	<b>1 393,9</b>	<b>5 324,1</b>
a. Compra temporal de moneda extranjera (oversold)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0087%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	419,8	425,0	586,0	892,8	10,0
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>702,7</b>	<b>892,1</b>	<b>892,1</b>	<b>892,1</b>	<b>5 314,1</b>
f Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 134,7	7 208,4	7 070,5	7 020,9	10 170,4
g Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	5,2	5,2	5,1	5,1	7,4
h Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 315,3	2 397,1	2 222,1	2 194,7	5 314,1
i Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	1,7	1,7	1,6	1,6	3,9
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1 679,0	1 738,5	1 480,2	1 339,1	1 272,5
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	2 752,75/2,75	2 752,80/2,76	2 752,80/2,79	2 852,90/2,87	2 902,90/2,90
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
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>25 Mayo 18</b>	<b>28 Mayo 18</b>	<b>29 Mayo 18</b>	<b>30 Mayo 18</b>	<b>31 Mayo 18</b>
Flejo de la posición global = a + b - c - d - e + f + g	-15,0	-24,4	25,2	-135,7	74,7
Flejo de la posición contable = a + b - c - d - e + f + g	85,5	29,2	27,2	-89,2	-136,9
a. Mercado spot con el público	89,0	10,1	16,6	-106,0	-164,7
i. Compras	380,4	231,4	341,9	233,4	274,3
ii. (-) Ventas	251,4	221,3	323,2	339,4	438,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	84,7	-44,7	126,5	0,4	-215,0
i. (-) Ventas	132,3	37,6	30,8	137,4	157,4
ii. (+) Ventas	47,6	82,3	183,3	131,2	402,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	184,5	-0,6	-104,9	86,5	-427,0
i. Placadas	223,0	17,5	131,5	202,3	292,6
ii. (-) Ventas	38,5	18,2	236,4	103,9	719,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1013,8	1040,9	1555,8	1433,3	1189,5
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-13,7	-55,0	61,2	57,8	339,6
i. Compras	27,6	17,7	231,9	191,8	1717,9
ii. (-) Ventas	41,3	72,6	172,9	43,8	378,3
f. Efecto de Opciones	-0,6	-0,4	-3,4	3,3	-0,4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	1,1	1,0	0,5	-0,4	5,5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2691	3,2714	3,2811	3,2696	3,2728
(*) Datos preliminares					