

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

	25 Junio 18	26 Junio 18	27 Junio 18	28 Junio 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	-375,0	184,5	1 036,9	-418,2
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
Plazo de vencimiento	201,5		111,0	189,0
Tasas de Inter Mínima	164 d		524 d	343 d
Máxima	2,57		2,70	2,62
Promedio	2,61		2,70	2,64
Saldo	2,59		2,70	2,63
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de julio de 2018	26 499,3	26 499,3	26 529,3	26 574,3
Vencimiento de CD BCRP del 2 al 6 de julio de 2018	750,1	750,1	780,1	750,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas	1500,0	1000,0	500,0	1100,0
Plazo de vencimiento	3000,0	1150,0	600,0	200,0
Tasas de Inter Mínima	1 d	1 d	1 d	4 d
Máxima	1,1	1,84 d	7 d	183 d
Promedio	2,81	2,78	2,84	3,40
Saldo	2,96	2,90	3,15	2,94
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 28 de junio de 2018	2,90	2,83	2,86	3,45
Vencimiento de REPO BCRP del 2 al 6 de julio de 2018	6 430,0	5 430,0	4 930,0	5 930,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)	2 500,0	1 000,0	500,0	2 030,0
Propuestas recibidas	3 000,0	1 500,0	500,0	3 230,0
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 2 al 6 de julio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 2 al 6 de julio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público				
Propuestas recibidas		300,0	300,0	300,0
Plazo de vencimiento		467,3	467,3	467,3
Tasas de Inter Mínima		365 d	365 d	365 d
Máxima		3,58	3,58	3,58
Promedio		3,85	3,85	3,85
Saldo	3 000,0	3 300,0	3 300,0	3 300,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 24 de julio de 2018	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 2 al 6 de julio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	510,0	510,0	510,0	510,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 09 de julio de 2018	510,0	510,0	510,0	510,0
Vencimiento de CDR BCRP del 2 al 6 de julio de 2018	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 Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	4 758,1	4 758,1	4 758,1	4 508,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 11 de julio de 2018	250,1	250,1	250,1	250,1
Vencimiento de REPO del 2 al 6 de julio de 2018	250,1	250,1	250,1	250,1
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 14 de Setiembre de 2018	800,0	800,0	800,0	800,0
Vencimiento de REPO Expansión del 2 al 6 de julio de 2018	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 Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	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
Vencimiento de REPO Sustitución del 2 al 6 de julio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	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
Vencimiento de SC - Venta del 2 al 6 de julio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 2 al 6 de julio de 2018	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Tipo de cambio promedio				
c. Ventas (millones de US\$)				
ii. 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	2 395,0	1 984,5	1 506,9	1 051,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0088%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	3,30%	3,30%	3,30%	3,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	1 415,0	1 040,5	818,0	322,4
Tasa de interés	1,50%	1,50%	1,50%	1,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	980,0	944,0	688,9	729,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 656,7	7 692,6	7 525,4	7 472,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,5	5,6	5,5	5,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 917,1	2 983,9	2 796,9	2 719,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,1	2,1	2,0	2,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CD BCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 121,1	1 137,0	1 306,0	1 035,1
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,75/2,90/2,80	2,75/2,75/2,75	2,70/2,75/2,75	2,75/2,75/2,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	59,0	50,0	0,0	145,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,00/2,00/2,00	2,00/2,00/2,00	2,00/2,00/2,00	2,00/2,00/2,00
c. Total mercado secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y CDV		20,0	50,0	10,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		20,0 / 2,64		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				10,0 / 2,62
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)				
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-64,9	108,8	-28,7	0,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	3,3	75,2	40,4	41,8
a. Mercado spot con el público				
i. Compras	-60,2	282,9	-51,3	12,7
ii. Ventas	223,9	303,8	280,2	391,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)				
i. Pactadas	-84,2	217,3	331,5	379,2
ii. Ventas	-65,4	-12,7	110,4	35,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)				
i. Pactadas	109,2	83,5	350,1	266,5
ii. Ventas	174,7	96,3	239,7	231,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	3,5	-46,9	98,0	76,3
ii. A futuro	157,1	133,8	330,8	276,2
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega				
i. Compras	153,5	190,8	232,8	199,9
ii. Ventas	620,4	553,5	794,3	929,0
f. Efecto de Opciones	1,0	1,0	7,0	0,0
g. Compras	41,3	66,6	2,1	-2,8
h. Ventas	111,9	153,2	217,8	188,9
i. Efecto de Opciones	0,7	-0,8	-0,7	0,0
ii. Compras	1,1	6,5	1,9	0,4
iii. Ventas				
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras				
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2679	3,2746	3,2704	3,2710
(*) Datos preliminares				