

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

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

	12 Junio 17	13 Junio 17	14 Junio 17	15 Junio 17	16 Junio 17
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>3 576,3</b>	<b>3 593,5</b>	<b>3 354,0</b>	<b>2 492,6</b>	<b>1 299,5</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	30,0	150,1	30,0	30,0	30,0
Plazo de vencimiento	178 d	177 d	181 d	362 d	362 d
Tasas de Inter Mínima	3,73	3,75	3,81	3,80	3,80
Máxima	3,79	3,79	3,82	3,84	3,81
Promedio	3,79	3,77	3,79	3,80	3,80
Saldo	26 233,3	26 533,4	26 863,4	26 833,4	26 733,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 19 de junio de 2017	60,0	60,0	60,0	100,0	100,0
Vencimiento de CD BCRP del 19 al 23 de junio de 2017	0,0	0,0	0,0	100,0	100,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					100,0
Plazo de vencimiento					230,0
Tasas de Inter Mínima					1096 d
Máxima					4,71
Promedio					4,62
Saldo	1 350,0	1 350,0	1 350,0	1 350,0	1 650,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 20 de junio de 2017	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO BCRP del 19 al 23 de junio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	500,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0	1 250,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 20 de junio de 2017	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 19 al 23 de junio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	300,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 277,0	1 690,3	200,0	1000,0	300,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	7 d	1 d	1 d
Tasas de Inter Mínima	3,36	3,20	3,35	3,40	3,34
Máxima	3,50	3,46	3,38	3,41	3,50
Promedio	3,42	3,40	3,37	3,38	3,40
Saldo	700,0	1 000,1	1 500,0	1 500,0	700,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 19 de junio de 2017	700,0	1 000,1	1 300,0	1 300,0	500,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 19 al 23 de junio de 2017	700,0	1 000,1	1 500,0	1 300,0	700,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 300,0	1 300,0	1 300,0	1 300,0	1 300,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 05 de julio de 2017	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 19 al 23 de junio de 2017	0,0	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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 19 al 23 de junio de 2017	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 Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	14 352,1	14 352,1	14 352,1	14 352,1	13 952,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 23 de junio de 2017	400,0	400,0	400,0	400,0	400,0
Vencimiento de REPO del 19 al 23 de junio de 2017	400,0	400,0	400,0	400,0	400,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 750,0	5 750,0	5 750,0	5 750,0	5 750,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 07 de julio de 2017	800,0	800,0	800,0	800,0	800,0
Vencimiento de REPO Expansión del 19 al 23 de junio de 2017	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 Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 061,7	4 061,7	4 061,7	4 061,7	3 861,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 23 de junio de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	131,7
Vencimiento de REPO Sustitución del 19 al 23 de junio de 2017	200,0	200,0	200,0	200,0	131,7
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	308,0	308,0	308,0	308,0	308,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 julio 2017	258,0	258,0	258,0	258,0	258,0
Vencimiento de SC - Venta del 19 al 23 de junio de 2017	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 Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3,5	3,5	3,5	3,5	3,5
Próximo vencimiento de SC-Compra el 20 junio 2017	3,5	3,5	3,5	3,5	3,5
Vencimiento de SC - Compra del 19 al 23 de junio de 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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>2 646,3</b>	<b>2 293,3</b>	<b>1 524,0</b>	<b>1 162,6</b>	<b>1 299,5</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0128%	0,0138%	0,0138%	0,0138%	0,0128%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés	72,3	138,3	96,6	63,1	53,3
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>2 574,0</b>	<b>2 155,1</b>	<b>1 427,4</b>	<b>1 099,5</b>	<b>1 246,2</b>
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 453,3	7 467,1	7 344,7	7 218,1	7 116,1
g. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6,2	6,1	6,1	6,0	5,9
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3 111,1	3 102,1	2 967,8	2 886,9	2 797,8
i. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,6	2,6	2,5	2,4	2,3
<b>6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	708,0	670,1	307,0	297,0	1 092,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,05/4,01	4,00/4,00/4,00	3,70/3,90/3,82	3,80/3,95/3,81	4,00/4,05/4,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	42,5	57,5	46,5	42,5	97,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,00/1,00/1,00	1,00/1,00/1,00	1,00/1,00/1,00	1,25/1,25/1,25	1,20/1,25/1,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	272,6	605,6	0,0	599,7	516,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		142,0 / 3,799			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		1,0 / 3,78			
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>09 Junio 17</b>	<b>12 Junio 17</b>	<b>13 Junio 17</b>	<b>14 Junio 17</b>	<b>15 Junio 17</b>
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	-66,6	72,4	-137,4	21,7	84,9
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	-25,8	16,7	-46,2	11,3	125,1
a. Mercado spot con el público	-82,9	-84,8	-84,4	-20,2	89,5
i. Compras	204,9	197,9	208,2	414,4	414,4
ii (-) Ventas	292,3	246,7	292,3	228,4	324,9
b. Contratos forward al público (con y sin entrega)	71,9	85,7	-85,7	51,7	-211,8
i. Pactadas	136,6	163,6	231,9	160,5	160,5
ii (-) Vencidas	62,8	89,6	219,0	180,1	372,2
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	114,7	32,5	39,6	41,6	-175,9
i. Pactadas	165,9	104,0	145,0	156,1	188,4
ii (-) Vencidas	51,3	71,6	109,3	114,6	364,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
Al contado	313,3	417,9	411,9	315,3	525,1
Al futuro	0,0	1,0	15,0	8,0	3,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	50,1	62,2	-61,2	-29,1	33,5
i. Compras	51,3	70,8	113,9	143,1	341,4
ii (-) Ventas	1,1	8,6	161,6	143,1	307,9
f. Efecto de opciones	0,0	2,4	-0,1	0,2	-4,3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-4,5	1,3	-10,3	-5,0	-5,9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2682	3,2774	3,2768	3,2695	3,2777
(*) Datos preliminares					