

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

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

	26 Junio 17	27 Junio 17	28 Junio 17
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>721,9</b>	<b>1 033,6</b>	<b>399,2</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	30,0		30,0
Plazo de vencimiento	119,5		43,0
Tasas de Inter Mínima	169 d		526 d
Máxima	3,8		3,8
Promedio	3,8		3,8
Saldo	26 753,3	26 753,3	26 783,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 6 de julio de 2017	1 490,2		1 490,2
Vencimiento de CD BCRP del 03 al 07 de julio de 2017	0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			
Propuestas recibidas	200,0	200,0	300,0
Plazo de vencimiento	530,0	515,0	500,0
Tasas de Inter Mínima	7 d	1 096 d	14 d
Máxima	4,26	4,55	4,30
Promedio	4,26	4,42	4,31
Saldo	4,26	4,42	4,31
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 03 de julio de 2017	4,26	4,59	4,49
Vencimiento de REPO BCRP del 03 al 07 de julio de 2017	3 310,0	3 310,0	4 512,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)			
Propuestas recibidas	200,0		200,0
Plazo de vencimiento	200,0		200,0
Tasas de Inter Mínima	200,0		200,0
Máxima	200,0		200,0
Promedio	200,0		200,0
Saldo	200,0	600,0	200,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 03 de julio de 2017	200,0		200,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 03 al 07 de julio de 2017	600,0		200,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			
Propuestas recibidas	0,0		0,0
Plazo de vencimiento	0,0		0,0
Tasas de Inter Mínima	0,0		0,0
Máxima	0,0		0,0
Promedio	0,0		0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo al	0,0		0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 03 al 07 de julio de 2017	0,0		0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público			
Propuestas recibidas	0,0		0,0
Plazo de vencimiento	0,0		0,0
Tasas de Inter Mínima	0,0		0,0
Máxima	0,0		0,0
Promedio	0,0		0,0
Saldo	1 600,0	1 600,0	1 600,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 5 de julio de 2017	800,0		500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 03 al 07 de julio de 2017	0,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			
Propuestas recibidas	0,0		0,0
Plazo de vencimiento	0,0		0,0
Tasas de Inter Mínima	0,0		0,0
Máxima	0,0		0,0
Promedio	0,0		0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0		0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 03 al 07 de julio de 2017	0,0		0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)			
Propuestas recibidas	711,0		150,0
Plazo de vencimiento	730 d		308,0
Tasas de Inter Mínima	4,11		730 d
Máxima	4,17		4,14
Promedio	4,13		4,14
Saldo	13 183,1	12 783,1	12 483,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 25 de Agosto de 2017	400,0		250,0
Vencimiento de REPO del 03 al 07 de julio de 2017	850,0		0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)			
Propuestas recibidas	5 750,0		5 750,0
Plazo de vencimiento	800,0		800,0
Tasas de Inter Mínima	0,0		0,0
Máxima	0,0		0,0
Promedio	0,0		0,0
Saldo	5 750,0	5 750,0	5 750,0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 07 de julio de 2017	800,0		800,0
Vencimiento de REPO Expansión del 03 al 07 de julio de 2017	0,0		0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)			
Propuestas recibidas	3 730,0		3 730,0
Plazo de vencimiento	200,0		200,0
Tasas de Inter Mínima	0,0		0,0
Máxima	0,0		0,0
Promedio	0,0		0,0
Saldo	3 730,0	3 730,0	3 730,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de enero de 2018	200,0		200,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 03 al 07 de julio de 2017	0,0		0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			
Propuestas recibidas	293,0		293,0
Plazo de vencimiento	243,0		243,0
Tasas de Inter Mínima	0,0		0,0
Máxima	0,0		0,0
Promedio	0,0		0,0
Saldo	293,0	293,0	293,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 julio 2017	243,0		243,0
Vencimiento de SC - Venta del 03 al 07 de julio de 2017	0,0		0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP			
Propuestas recibidas	0,0		0,0
Plazo de vencimiento	0,0		0,0
Tasas de Inter Mínima	0,0		0,0
Máxima	0,0		0,0
Promedio	0,0		0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0		0,0
Vencimiento de SC - Compra del 03 al 07 de julio de 2017	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	0,0	0,0	0,0
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>1 291,9</b>	<b>1 233,6</b>	<b>1 721,2</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0139%	0,0139%	0,0139%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	70,0	296,0	315,1
Tasa de interés	2,75%	2,75%	2,75%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>1 221,9</b>	<b>937,6</b>	<b>1 406,1</b>
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 392,1	6 417,5	6 327,5
g. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,3	5,4	5,3
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 143,0	2 095,3	2 070,7
i. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,8	1,8	1,7
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 367,0	1 246,0	568,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,05/4,02	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	98,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio			1,25/1,25/1,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	224,8	17,6	278,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	81,0 / 3,79	17,6 / 3,77	30,0 / 3,76
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			1,0 / 3,78
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>23 junio 17</b>	<b>26 junio 17</b>	<b>27 junio 17</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-3,3	5,4	33,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	157,6	10,2	117,9
a. Mercado spot con el público	83,1	-20,4	36,3
i. Compras	386,4	248,8	338,3
ii. (-) Ventas	303,3	269,1	302,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	49,9	8,5	-147,4
i. Pactadas	89,9	215,6	139,5
ii. (-) Vencidas	40,0	207,1	287,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	205,2	15,9	-75,4
i. Pactadas	277,8	142,0	401,7
ii. (-) Vencidas	71,6	126,1	478,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	298,1	310,0	603,9
ii. A futuro	15,0	3,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	68,8	-47,9	217,1
i. Compras	70,6	123,9	468,3
ii. (-) Ventas	1,8	171,8	251,1
f. Efecto de Opciones	-0,1	2,7	-13,4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	32,8	-2,6	55,6
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2559	3,2525	3,2553
(*) Datos preliminares			