

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

(Millones de Soles)

	3 Junio 19	4 Junio 19	5 Junio 19	6 Junio 19	7 Junio 19
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>726,8</b>	<b>1 451,0</b>	<b>1 832,5</b>	<b>3 878,7</b>	<b>3 837,4</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	200,1
Plazo de vencimiento	139,0		246,0	348,5	446,5
Tasas de interés	183,4		546,4	361,4	541,4
Máxima	2,49		2,70	2,61	2,88
Promedio	2,59		2,70	2,62	2,68
Saldo	27 553,9	27 553,9	27 603,9	26 424,0	26 624,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de junio de 2019	1 585,0	1 585,0	1 585,0	1 585,0	1 585,0
Vencimiento de CD BCRP del 10 al 14 de junio de 2019	1 585,0	1 585,0	1 585,0	1 585,0	1 585,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1000,0	2200,0	1000,0	1000,0	1000,0
Plazo de vencimiento	3100,0	4440,0	2865,0	3355,0	2100,0
Tasas de interés	1,0	1,0	1,0	1,0	3,0
Máxima	2,91	2,85	2,90	2,91	3,07
Promedio	2,91	2,85	2,96	3,0	3,11
Saldo	8 950,0	8 500,0	7 850,0	6 750,0	6 750,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 10 de junio de 2019	3 200,0	2 750,0	2 100,0	1 000,0	1 000,0
Vencimiento de REPO BCRP del 10 al 14 de junio de 2019	3 200,0	2 750,0	2 100,0	1 000,0	1 000,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de COLD BCRP el 10 al 14 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de COLD BCRP del 10 al 14 de junio de 2019	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 interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 10 al 14 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 400,0	4 400,0	4 400,0	4 400,0	4 400,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de junio de 2019	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 10 al 14 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reestructurados del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
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 10 al 14 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas	500,0	200,0	200,0	200,0	0,0
Plazo de vencimiento	854,0	605,0	605,0	652,0	183,4
Tasas de interés	183,4	366,4	366,4	366,4	3,39
Máxima	3,39	3,51	3,56	3,53	3,58
Promedio	3,47	3,52	3,50	3,51	3,58
Saldo	11 953,1	11 253,1	11 653,1	11 653,1	11 431,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 14 de junio de 2019	222,0	222,0	222,0	222,0	150,0
Vencimiento de REPO del 10 al 14 de junio de 2019	222,0	222,0	222,0	222,0	150,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Expansión del 10 al 14 de junio de 2019	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 interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 10 al 14 de junio de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 22 de julio 2019	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de SC - Venta del 10 al 14 de junio de 2019	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 interés					
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 10 al 14 de junio de 2019	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\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)					
iii. Tipo de cambio promedio					
iv. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	27,9	35,8	0,0	0,0	0,0
v. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	27,9	35,8			
vi. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
vii. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
viii. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ix. Compras de BTP					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>4 376,8</b>	<b>4 401,0</b>	<b>4 282,5</b>	<b>4 528,6</b>	<b>4 437,3</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0094%	0,0105%	0,0105%	0,0105%	0,0106%
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 rotulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,1	0,0	0,0	0,0	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>4 371,7</b>	<b>4 401,0</b>	<b>4 282,5</b>	<b>4 528,6</b>	<b>4 427,3</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 552,0	8 357,9	8 357,9	8 776,1	8 776,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,0	5,5	5,7	5,7	5,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 194,8	2 978,3	2 978,3	3 404,3	3 404,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,4	1,9	1,9	2,2	2,2
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	833,8	933,3	780,2	1 049,5	1 064,5
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	2 752,75/2,75	2 752,75/2,75	2 752,75/2,75	2 752,75/2,75	2 752,75/2,75
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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>31 Mayo 19</b>	<b>03 Junio 19</b>	<b>04 Junio 19</b>	<b>05 Junio 19</b>	<b>06 Junio 19</b>
Flujo de la posición global = a + b + c + e + f + g	-110,9	149,2	-71,7	-54,7	-14,3
Flujo de la posición contable = a + b + i - c + j + e + g	-133,9	118,9	-131,9	59,2	-86,7
a. Mercado spot con el público	-189,2	72,7	-46,9	-104,9	-86,4
i. Compras	287,6	367,1	227,6	329,6	229,6
ii. (-) Ventas	476,8	294,4	326,6	434,6	316,0
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrea)	110,9	89,2	111,4	62,9	-89,3
i. Pactadas	224,6	216,8	216,8	276,5	276,5
ii. (-) Vencidas	113,7	128,9	176,4	248,1	374,8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrea)	88,2	55,5	50,0	176,6	-170,6
i. Pactadas	223,4	174,9	327,4	374,9	444,9
ii. (-) Vencidas	145,1	119,4	329,4	329,4	615,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	660,4	583,2	483,0	637,3	442,0
ii. A futuro	59,0	66,0	39,0	62,0	6,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrea	67,1	36,3	-89,9	282,7	282,7
i. Compras	140,0	115,6	271,1	150,2	684,2
ii. (-) Ventas	72,9	79,3	240,9	101,5	381,5
f. Efecto de Opciones	0,8	-2,5	-1,3	-0,1	-0,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-3,6	0,7	-7,1	3,6	-2,4
h. Crédito por rotulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Databank)	3,3730	3,3701	3,3482	3,3519	3,3337
(*) Datos preliminares					