

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	22 Agosto 16	23 Agosto 16	24 Agosto 16	25 Agosto 16	26 Agosto 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 050,4	2 716,2	2 502,6	3 264,9	3 626,2
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)	50,0	99,9	100,0	50,0	50,0
Propuestas recibidas	232,0	459,0	360,0	285,5	326,0
Plazo de vencimiento	178 d	360 d	359 d	539 d	357 d
Tasas de Inter Mínima	4,54	4,78	4,82	4,94	4,73
Máxima	4,55	4,88	4,85	4,97	4,73
Promedio	4,55	4,84	4,83	4,95	4,73
Saldo	24 642,1	24 842,1	24 892,1	24 942,1	24 942,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 08 de setiembre de 2016	589,0		589,0		589,0
Vencimiento de CD BCRP del 29 de agosto al 02 de setiembre de 2016	0,0		0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	800,0	800,0	800,0	800,0	800,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 30 de Setiembre de 2016	200,0		200,0		200,0
Vencimiento de Repo BCRP del 29 de agosto al 02 de setiembre de 2016	0,0		0,0		0,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
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 Repo Especial - CDR	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 29 de agosto al 02 de setiembre de 2016	0,0		0,0		0,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV 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 CDV BCRP el	0,0		0,0		0,0
Vencimientos de CDV BCRP del 29 de agosto al 02 de setiembre de 2016	0,0		0,0		0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	780,0	500,0	1000,0	500,0	801,4
Propuestas recibidas	980,3	525,0	1073,6	544,4	801,4
Plazo de vencimiento	1 d	8 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de Inter Mínima	3,96	4,05	3,98	4,25	4,00
Máxima	4,15	4,24	4,25	4,25	4,15
Promedio	4,07	4,18	4,14	4,19	4,15
Saldo	2 200,1	2 500,1	2 540,1	2 801,3	2 883,9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 29 agosto 2016	700,0		1 500,0		1 500,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 29 de agosto al 02 de setiembre de 2016	2 200,1		1 500,0		2 883,9
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 2 Setiembre de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 29 de agosto al 02 de setiembre de 2016	0,0		0,0		300,0
vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
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 Coloc-BN el	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de Coloc - BN del 29 de agosto al 02 de setiembre de 2016	0,0		0,0		0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 048,0	848,0	848,0	848,0	848,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 29 de agosto de 2016	200,0		200,0		200,0
Vencimiento de CDR BCRP del 29 de agosto al 02 de setiembre de 2016	200,0				748,0
ix. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	15 200,1	15 200,1	15 200,1	15 200,1	15 200,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 03 de Octubre de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO del 29 de agosto al 02 de setiembre de 2016	0,0		0,0		0,0
x. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Expansion)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 17 de Enero de 2017	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO Expansion del 29 de agosto al 02 de setiembre de 2016	0,0		0,0		0,0
xi. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Sustitucion)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 26 de Mayo de 2017	243,0		243,0		243,0
Vencimiento de REPO Sustitucion del 29 de agosto al 02 de setiembre de 2016	0,0		0,0		0,0
xii. Subasta de Swap Cambiaria Venta del BCRP					
Propuestas recibidas		200,0			
Plazo de vencimiento		822,0			
Tasas de Inter Mínima		62 d			
Máxima		-0,21			
Promedio		-0,07			
Saldo	2 794,2	2 844,2	2 679,2	2 412,5	2 412,5
Próximo vencimiento de SC-Venta el 29 de Agosto de 2016	215,0		9,1		75,0
Vencimiento de SC - Venta del 29 de agosto al 02 de setiembre de 2016	224,1		9,1		380,9
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	0,0	0,0
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 200,5	1 016,2	1 412,6	1 453,7	1 282,3
4. Operaciones monetarias del BCR por el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0135%	0,0135%	0,0135%	0,0135%	0,0135%
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					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	105,0	49,0	425,0	495,0	419,0
Tasa de interés	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 095,5	967,2	987,6	958,7	863,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	7 998,1	7 841,2	7 845,2	7 739,2	7 700,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,2	7,0	7,0	7,0	6,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 814,1	2 734,3	2 661,5	2 587,9	2 521,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,5	2,4	2,4	2,3	2,3
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	909,3	585,0	765,0	601,5	397,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,10 / 4,15 / 4,10	4,10 / 4,15 / 4,10	4,25 / 4,30 / 4,26	4,25 / 4,25 / 4,25	4,25 / 4,25 / 4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	79,0	79,0	191,4
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio			0,40 / 0,40 / 0,40	0,40 / 0,40 / 0,40	0,40 / 0,45 / 0,40
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	1,9	170,0	235,0	100,0	100,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	1,0 / 6,82	30,0 / 4,48			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			75,0 / 4,83		
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)				100,0 / 5,00	100,0 / 5,00
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	19 agosto 16	22 agosto 16	23 agosto 16	24 agosto 16	25 agosto 16
Flujo de la posición global = a + b i - c i + e + f + g	114,1	-6,8	68,6	-111,8	19,2
Flujo de la posición contable = a + b ii - c ii + e + f + g	179,4	39,1	48,9	-48,9	37,7
a. Mercado spot con el público	152,2	58,3	122,4	-38,3	67,3
i. Compras	299,4	192,7	238,7	171,3	258,7
ii (c) Ventas	147,2	134,4	116,4	209,6	191,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	17,9	-8,7	11,0	-21,4	-37,4
i. Placadas	85,7	132,8	142,4	167,6	86,3
ii (c) Vencidas	67,7	219,5	131,5	186,7	136,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	37,2	-39,0	6,7	1,3	-98,8
i. Placadas	130,8	120,0	102,4	82,4	82,8
ii (c) Vencidas	93,7	159,0	174,8	101,1	181,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	308,9	350,4	465,3	379,5	253,7
ii. A futuro	15,0	0,0	0,0	10,0	3,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	52,6	-81,4	32,6	-83,0	16,3
i. Compras	90,6	133,1	96,1	96,1	139,7
ii (c) Ventas	38,3	214,5	129,5	129,5	121,4
f. Efecto de Opciones	0,5	3,3	0,9	15,7	-0,5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-45,6	0,2	-48,1	-81,4	-81,4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,3212	3,3425	3,3582	3,3534	3,3503