

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU				
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS (Millones de Soles)				
	31 Octubre 16	02 Noviembre 16	03 Noviembre 16	04 Noviembre 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 539,7	1 448,5	1 401,0	361,8
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	122,0	118,9	154,2	
Tasas de Inter Mínima	192,4	561,4	371,4	
Máxima	4,38	4,44	4,36	
Promedio	4,38	4,70	4,50	
Saldo	27 495,0	27 525,0	27 555,0	27 555,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de noviembre de 2016	125,0	125,0	125,0	125,0
Vencimiento de CD BCRP del 07 al 11 de Noviembre de 2016	0,0	0,0	0,0	1 570,8
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas		2 000,0	2 400,0	3 400,0
Plazo de vencimiento		3 805,5	4 085,8	4 249,8
Tasas de Inter Mínima		1,4	1,4	1,4
Máxima		4,46	4,65	4,41
Promedio		4,60	4,81	4,91
Saldo	600,0	2 600,0	3 000,0	4 000,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 7 de noviembre de 2016	300,0	4,58	4,74	4,79
Vencimiento de REPO BCRP del 07 al 11 de Noviembre de 2016	0,0	2 000,0	2 400,0	3 400,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)				
Propuestas recibidas		2 000,0	2 400,0	3 400,0
Plazo de vencimiento		0,0	0,0	0,0
Tasas de Inter Mínima		0,0	0,0	0,0
Máxima		0,0	0,0	0,0
Promedio		0,0	0,0	0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 07 al 11 de Noviembre de 2016	0,0	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
Próximo vencimiento de CDV BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de CDV BCRP del 07 al 11 de Noviembre de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0
v. 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 07 al 11 de Noviembre de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	1 300,0	1 300,0	1 300,0	1 300,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 15 Diciembre de 2016	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 07 al 11 de Noviembre de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0
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
Próximo vencimiento de Coloc-BN el	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Coloc - BN del 07 al 11 de Noviembre de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Resustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	1 100,0	1 000,0	1 000,0	1 000,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 14 de noviembre de 2016	100,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de CDR BCRP del 07 al 11 de Noviembre de 2016	100,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	14 737,1	14 737,1	14 737,1	14 237,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 16 de Junio de 2017	500,0	500,0	500,0	400,0
Vencimiento de REPO del 07 al 11 de Noviembre de 2016	500,0	500,0	500,0	0,0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO Expansión del 07 al 11 de Noviembre de 2016				
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017	243,0	243,0	243,0	243,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 07 al 11 de Noviembre de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta 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-Venta el				
Vencimiento de SC - Venta del 07 al 11 de Noviembre de 2016				
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR	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				
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
Compras de BTP				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 509,7	3 418,5	3 771,0	3 761,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0127%	0,0134%	0,0134%	0,0133%
Tasa de interés	45,0	235,0		
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnigh en moneda nacional	606,2	82,5	80,4	80,4
Tasa de interés	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	948,5	3 569,6	3 688,5	3 681,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	7 343,7	7 415,8	7 650,4	7 751,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,6	6,1	7,2	7,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 177,2	2 259,1	2 681,0	2 614,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	1,9	2,5	2,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	985,5	1 102,5	1 244,0	1 060,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,40/4,35
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	27,8	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,50/0,55/0,51	0,65/0,65/0,65		
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	45,0			9,3
Plazo 5 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	20,0/4,38			
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 octubre 16	31 octubre 16	02 noviembre 16	03 noviembre 16
Flujo de la posición abcd = a + b - c - d + e + f + g	20,1	57,2	-102,6	-82,1
Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + g	51,3	-32,2	62,3	-20,9
a. Mercado spot con el público	99,8	13,8	117,1	-16,0
i. Compras	327,0	254,9	313,8	209,4
ii. Ventas	227,2	241,1	196,7	225,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-4,0	-186,8		-82,2
i. Pactadas	136,1	128,6		128,6
ii. (c) Vencidas	140,0	134,1		210,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	30,4	-100,2	-4,2	-21,2
i. Pactadas	243,6	147,2		251,9
ii. (c) Vencidas	213,2	243,3		273,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	741,6	286,2	468,2	351,1
ii. A futuro	14,0	22,0	3,0	12,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards en entrega	86,6	89,4	49,4	62,9
i. Compras	197,9	173,9	187,7	271,9
ii. (c) Ventas	111,3	124,5	252,1	208,9
f. Efecto de Operaciones	3,2	-0,3	-0,3	-0,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-62,0	-27,3	-38,7	-5,8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Dattac)	3,3606	3,3627	3,3804	3,3779
(*) Datos preliminares				