

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

(Millones de Soles)

	1 Julio 16	4 Julio 16	5 Julio 16	6 Julio 16	7 Julio 16	8 Julio 16
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarías antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>1 242,2</b>	<b>1 957,6</b>	<b>2 093,6</b>	<b>3 306,8</b>	<b>4 574,1</b>	<b>3 948,9</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	30,1	
Plazo de vencimiento		137,0		158,0	170,0	
Tasas de inter Minima		185,4		554,4	364,4	
Máxima		4,40		4,95	4,70	
Promedio		4,40		4,38	4,70	
Saldo	400,0	16 153,3	16 153,3	16 183,3	16 213,4	16 213,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Julio de 2016	0,0				400,0	400,0
Vencimiento de CD BCRP entre el 11 v el 15 de Julio de 2016						1 820,2
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)						
Propuestas recibidas	500	2300	1000	500	600	210,0
Plazo de vencimiento	1550	3940	2990	2150	910	210,0
Tasas de inter Minima	7 d	3 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Máxima	5,31	4,60	4,81	4,75	4,75	4,25
Promedio	5,31	4,95	4,81	4,86	4,80	4,30
Saldo	3 600,0	4,86	4,81	4,82	4,80	4,26
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 11 de Julio de 2016			3 100,0			1 300,0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 11 v el 15 de Julio de 2016						300,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Reo Especial - CDR)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de inter Minima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Reo Especial - CDR						0,0
Vencimiento de Reo Especial - CDR entre el 11 v el 15 de Julio de 2016						0,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de inter Minima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el						0,0
Vencimientos de CDV BCRP entre el 11 v el 15 de Julio de 2016						0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de inter Minima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 2 de Septiembre de 2016						300,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 11 v el 15 de Julio de 2016						0,0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación						
Propuestas recibidas				500,0		
Plazo de vencimiento				1 396,0		
Tasas de inter Minima				395,4		
Máxima				5,78		
Promedio				6,60		
Saldo	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el						300,0
Vencimiento de Coloc-BN entre el 11 v el 15 de Julio de 2016						0,0
vii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de inter Minima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el						0,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 11 v el 15 de Julio de 2016						0,0
viii. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Regular)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de inter Minima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	3 105,0	3 105,0	3 105,0	3 105,0	3 105,0	3 105,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 12 de Julio de 2016						165,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 11 v el 15 de Julio de 2016						390,0
ix. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Expansión)						
Propuestas recibidas				300,0		
Plazo de vencimiento				1 270,0		
Tasas de inter Minima				549,4		
Máxima				6,15		
Promedio				5,21		
Saldo	15 800,1	15 800,1	15 800,1	15 800,1	15 800,1	15 800,1
Próximo vencimiento de Reo Regular el 11 de Julio de 2016						300,0
Vencimiento de REPO entre el 11 v el 15 de Julio de 2016						300,0
x. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Expansión)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de inter Minima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	7 900,0	7 900,0	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
Vencimiento de REPO Expansión entre el 11 v el 15 de Julio de 2016						0,0
xi. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Sustitución)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de inter Minima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7
Próximo vencimiento de Reo Sustitución el 26 de Mayo de 2017						243,0
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 11 v el 15 de Julio de 2016						0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de inter Minima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	12 132,8	12 132,8	11 705,8	11 705,8	10 557,0	10 557,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 de Julio de 2016						80,7
Vencimiento de SC - Venta entre el 11 v el 15 de Julio de 2016						524,7
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR						
i. Compras (millones de US\$)	3,3	190,5	0,0	916,1	6,6	958,0
ii. Ventas (millones de US\$)	1,0	58,0	0,0	279,1	2,0	232,0
iii. Tipo de cambio promedio	3,2850	3,2849		3,2823	3,2820	3,2809
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-NR y BTP						
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTP						
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarías en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>4 045,5</b>	<b>4 418,1</b>	<b>4 393,6</b>	<b>5 492,9</b>	<b>4 760,5</b>	<b>4 906,9</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>						
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)						
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0127%	0,0137%	0,0137%	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%	4,80%
c. Crédito por regularización monetaria en moneda nacional	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés	270,9	317,8	316,1	300,9	1 050,0	1 663,7
Depósitos Overnight en moneda nacional	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarías en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>3 774,8</b>	<b>4 100,3</b>	<b>4 077,5</b>	<b>5 192,0</b>	<b>3 710,5</b>	<b>3 243,2</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/)) (*)	6 979,5	6 979,5	6 979,5	6 979,5	6 979,5	8 966,5
b. Fondos de encaje en moneda extranjera (promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,7	6,7	6,7	6,7	6,7	6,6
c. Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/))	1 964,1	3 774,6	3 856,0	3 900,3	4 115,6	4 006,6
d. Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,9	1,9	1,9	1,9	1,9	1,8
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>						
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	465,0	455,0	355,0	269,5	269,5	487,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,254/804,6/4	4,704/704,70	4,504/804,6/1	4,254/504,4/1	4,254/254,2/5	4,254/254,2/5
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	97,0	192,0	140,0	185,0	88,0	68,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,400/400,40	0,400/450,4/1	0,400/400,40	0,400/450,4/1	0,450/450,4/5	0,450/450,4/5
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	10,0			27,1	11,3	11,3
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		30 / 4,40				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					11,3 / 4,70	
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)						
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarías (millones de US\$)</b>	<b>30 Julio 16</b>	<b>01 Julio 16</b>	<b>04 Julio 16</b>	<b>05 Julio 16</b>	<b>06 Julio 16</b>	<b>07 Julio 16</b>
Flujo de la posición global = a + b + c + d + e + f + g	-117,8	99,2	-107,9	63,1	-21,3	-11,8
Flujo de la posición contable = a + b + c + d + e + f + g	242,8	49,5	49,7	83,0	243,3	229,6
a. Mercado spot con el público	154,3	113,5	-15,5	85,9	38,3	247,0
i. Compras	478,9	310,7	184,5	260,9	256,0	416,8
ii. (-) Ventas	-324,6	197,2	200,0	175,0	266,7	188,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-191,5	61,6	11,8	17,5	164,2	-42,6
i. (-) Pactadas	143,0	133,0	20,7	199,9	299,4	150,8
ii. (+) Vencidas	334,3	71,4	8,8	182,4	136,2	203,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-70,9	-104,4	-49,0	-84,8	-56,4	-151,1
i. (-) Pactadas	236,3	103,0	33,0	71,2	54,3	37,5
ii. (+) Vencidas	306,2	208,0	4,2	166,1	110,7	196,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias						
i. Al contado	275,4	512,5	337,0	466,5	483,2	265,9
ii. A futuro	30,0	5,0	0,0	17,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	63,5	86,9	3,8	-14,4	-26,7	-23,3
i. Compras	296,0	158,2	3,8	162,6	105,1	178,5
ii. (-) Ventas	-222,6	67,3	0,0	177,0	130,8	201,7
f. Impacto de Lípionnes	1,6	-8,6	-0,9	-2,2	1,3	-1,9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-244,8	-122,0	-134,9	-134,9	-280,3	-346,5
h. Crédito por regularización monetaria en moneda extranjera						
Tasa de interés						
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datarec)	3,2890	3,2873	3,2847	3,2873	3,2809	3,2840
(*) Datos preliminares						