

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	18 Julio 16	19 Julio 16	20 Julio 16	21 Julio 16	22 Julio 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	6 893.5	5 747.5	5 788.2	4 758.5	4 170.8
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	300,0	300,0	200	459
Plazo de vencimiento	30,0	590,0	748,0	467	459
Tasas de interés	171 d	350 d	540 d	86 d	539 d
Mínima	4,30	4,50	4,75	4,25	4,87
Máxima	4,50	4,80	4,99	4,50	5,30
Promedio	4,43	4,71	4,91	4,43	5,14
Saldo	19 913,3	20 572,3	20 522,3		
Próximo vencimiento de CD BCRP el 25 de Julio de 2016					
Vencimiento de CD BCRP del 25 al 27 de Julio de 2016					
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 000,0	1 000,0	1 000,0	1 000,0	1 000,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 05 de Agosto de 2016					
Vencimiento de REPO BCRP del 25 al 27 de Julio de 2016					
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR					
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 25 al 27 de Julio de 2016					
iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el					
Vencimientos de CDV BCRP del 25 al 27 de Julio de 2016					
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	3 324,5	2 000,0	1 800,0	2 000,0	1 199,8
Plazo de vencimiento	3 324,5	3 077,9	2 000,6	2 028,1	1 697,5
Tasas de interés	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Mínima	4,00	3,98	3,97	3,99	3,98
Máxima	4,06	4,03	4,04	4,20	4,15
Promedio	4,03	4,00	3,99	4,03	4,07
Saldo	4 000,0	3 800,0	3 778,1	3 199,8	3 000,1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 25 de Julio de 2016					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 25 al 27 de Julio de 2016					
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
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					
Vencimiento de Coloc-TP del 25 al 27 de Julio de 2016					
vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el					
Vencimiento de Coloc - BN del 25 al 27 de Julio de 2016					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reaustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 484,0	2 194,0	1 937,0	1 937,0	1 937,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 26 de Julio de 2016					
Vencimiento de CDR BCRP del 25 al 27 de Julio de 2016					
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	15 700,1	15 700,1	15 700,1	15 700,1	15 700,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 19 de Agosto de 2016					
Vencimiento de REPO del 25 al 27 de Julio de 2016					
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	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					
Vencimiento de REPO Expansión del 25 al 27 de Julio de 2016					
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017					
Vencimiento de REPO Sustitución del 25 al 27 de Julio de 2016					
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas		200,0	200,0	500	100
Plazo de vencimiento		549,0	385,0	888	318
Tasas de interés		62 d	62 d	62 d	62 d
Mínima		0,19	0,29	0,19	0,23
Máxima		0,44	0,70	0,29	0,23
Promedio		0,30	0,47	0,24	0,23
Saldo	7 418,3	7 323,4	7 283,4	7 193,4	7 063,4
Próximo vencimiento de SC-Venta el 25 de Julio de 2016					
Vencimiento de SC - Venta del 25 al 27 de Julio de 2016					
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					
Tipo de cambio promedio					
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					
Tipo de cambio promedio					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2 263,5	1 288,5	1 460,1	1 168,7	1 070,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0138%	0,0137%	0,0136%	0,0136%	0,0136%
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 Overnigth en moneda nacional					
Tasa de interés	7,44,7	250,0	394,1	41,2	292,7
Promedio	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	1 518,8	1 038,5	1 066,5	1 067,5	778,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 139,8	8 200,3	7 939,0	7 939,0	7 939,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	7,7	7,7	7,5	7,5	7,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 193,4	2 907,0	2 808,7	2 815,0	2 815,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	2,8	2,9	2,6	2,6	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	555,5	763,5	1 091,0	1 393,0	1 729,0
Tasas de interés - Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,30	4,25/4,25/4,25	4,25/4,30/4,25	4,25/4,30/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	97,1	43,0	35,0	30,0	10,0
Tasas de interés - Mínima / Máxima / Promedio	0,60/0,65/0,61	0,60/0,60/0,60	0,60/0,60/0,60	0,60/0,60/0,60	0,60/0,60/0,60
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	120,0	185,0	50,7	281,0	
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	120 / 4,39	55,0 / 4,55	8,7 / 4,56	15,0 / 4,60	
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)		130 / 4,64	40,0 / 4,61	120,0 / 4,61	
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	15 julio 16	18 julio 16	19 julio 16	20 julio 16	21 julio 16
Flujo de la posición global = a + b - c - d + e + f + g	-42,2	135,7	16,6	-33,6	-4,8
Flujo de la posición contable = a + b + d - c + e + f + g	-20,3	-33,9	-2,4	149,8	58,4
a. Mercado spot con el público	281,0	97,6	107,7	189,1	70,5
i. Compras	435,0	243,2	231,9	322,7	288,4
ii. (-) Ventas	154,0	145,6	124,2	133,6	197,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	313,5	51,7	-37,6	-4,6	-17,0
i. Pactadas	398,5	241,0	32,7	247,9	185,2
ii. (-) Vendidas	77,0	189,3	70,3	252,3	202,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	17,7	-137,2	-94,2	162,1	26,2
i. Pactadas	155,6	40,4	37,2	207,9	177,1
ii. (-) Vendidas	137,9	177,6	131,4	45,8	151,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
Al contado	241,6	187,0	385,6	379,5	527,5
A futuro	20,0	15,0	27,0	17,0	25,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	46,0	-82,4	37,2	-171,5	-53,8
i. Compras	117,6	104,1	91,6	43,1	135,3
ii. (-) Ventas	71,6	186,5	54,4	214,6	189,0
f. Efecto de Dicciones	-0,9	-0,2	-7,5	-3,3	0,7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-603,2	-79,8	-116,3	-87,9	-30,3
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2780	3,2791	3,2948	3,3105	3,3224
(*) Datos preliminares					