

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU				
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS				
(Millones de Soles)				
	29 Agosto 16	31 Agosto 16	01 Setiembre 16	02 Setiembre 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	4 138,1	4 382,8	4 221,4	4 248,7
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	49,9	100,0	100,0	50,0
Plazo de vencimiento	215,2	320,0	392,0	294,5
Tasas de Interés	171 d	171 d	533 d	531 d
Mínima	4,50	4,59	4,90	4,75
Máxima	4,60	4,65	5,00	4,75
Promedio	4,54	4,62	4,95	4,75
Saldo				
Próximo vencimiento de CD BCRP el 08 de setiembre de 2016		25 192,0	25 242,0	25 292,0
Vencimiento de CD BCRP del 05 al 09 de setiembre de 2016			589,0	589,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 30 de Setiembre de 2016	800,0	800,0	800,0	800,0
Vencimiento de REPO BCRP del 05 al 09 de setiembre de 2016		0,0	0,0	200,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 05 al 09 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 Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de CDV BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de CDV BCRP del 05 al 09 de setiembre de 2016		0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas	1000,0	1900,1	1000,1	2217,6
Plazo de vencimiento	1020,9	1900,1	1402,8	2217,6
Tasas de Interés	2 d	2 d	1 d	1 d
Mínima	4,12	4,15	4,15	4,06
Máxima	4,25	4,24	4,23	4,25
Promedio	4,22	4,22	4,22	4,21
Saldo				
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	3 440,1	3 257,7	3 257,7	3 257,7
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 05 al 09 de setiembre de 2016		0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 15 Diciembre de 2016	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 05 al 09 de setiembre de 2016		300,0	300,0	300,0
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				
Próximo vencimiento de Coloc-BN el	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Coloc - BN del 05 al 09 de setiembre de 2016		0,0	0,0	0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Resguarables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas	100,0	100,0	100,0	100,0
Plazo de vencimiento	310,0	180,0	233,0	233,0
Tasas de Interés	60 d	61 d	62 d	62 d
Mínima	-0,21	-0,10	-0,00	-0,00
Máxima	-0,03	-0,05	0,00	0,00
Promedio	-0,09	-0,07	0,00	0,00
Saldo	748,0	780,0	680,0	400,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 22 de setiembre de 2016		200,0	200,0	100,0
Vencimiento de CDR BCRP del 05 al 09 de setiembre de 2016		480,0	480,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo Regular el 03 de Octubre de 2016	15 200,1	15 200,1	15 200,1	15 200,1
Vencimiento de Repo Regular del 05 al 09 de setiembre de 2016		300,0	300,0	300,0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0
Vencimiento de REPO Expansión del 05 al 09 de setiembre de 2016		300,0	300,0	300,0
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Interés				
Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7
Vencimiento de REPO Sustitución del 05 al 09 de setiembre de 2016		243,0	243,0	243,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				
Propuestas recibidas	200,0	100,0	100,0	100,0
Plazo de vencimiento	695,0	436,0	579,0	579,0
Tasas de Interés	60 d	61 d	62 d	62 d
Mínima	-0,35	-0,50	-0,55	-0,55
Máxima	-0,20	-0,44	-0,55	-0,55
Promedio	-0,27	-0,44	-0,55	-0,55
Saldo	2 537,5	2 487,5	2 587,5	2 314,6
Próximo vencimiento de SC-Venta el 08 de Setiembre de 2016		155,9	155,9	100,0
Vencimiento de SC - Venta del 05 al 09 de setiembre de 2016		0,0	0,0	100,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
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				
ii. Compras de BTP				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	888,1	1 015,1	4 071,4	4 248,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0135%	0,0133%	0,0133%	0,0133%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de Interés	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%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional				
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	490,1	511,6	3 981,4	4 107,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	7 511,0	7 562,6	9 232,4	8 402,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,7	6,9	11,0	22,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 458,9	2 332,6	2 166,1	3 137,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	2,1	4,7	8,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CD BCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional				
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	614,0	299,0	1 032,0	1 493,0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	10,0	13,0	0,0	13,0
c. Total mercado secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y CDV	0,45/0,45/0,45	0,40/0,40/0,40	0,0	0,45/0,45/0,45
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	160,0	139,4	0,0	6,8
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		3,9 / 4,60		
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	26 agosto 16	29 agosto 16	31 agosto 16	01 setiembre 16
Flujo de la posición global = a + b - i - c + e + f + g	-2,9	3,7	165,9	-116,1
Flujo de la posición contable = a + b - i - c + e + f + g	36,9	-77,9	137,3	133,2
a. Mercado spot con el público				
i. Compras	40,1	-43,0	122,7	38,0
ii. Ventas	250,6	229,9	232,9	232,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)				
i. Compras	210,5	272,2	240,2	196,7
ii. Ventas	-93,9	111,0	144,8	-186,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)				
i. Compras	101,7	170,7	198,1	50,0
ii. Ventas	195,6	69,7	63,1	236,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	423,9	270,2	254,9	317,7
ii. A futuro	5,0	0,0	5,0	5,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega				
i. Compras	-50,1	100,8	102,8	-11,8
ii. Ventas	130,3	139,6	139,6	197,4
f. Efecto de Opciones	182,3	38,8	38,8	209,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	10,6	-3,3	10,3	10,3
h. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-10,5	2,8	-8,6	1,9
i. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de Interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datarec)				
(*) Datos preliminares	3.3449	3.3705	3.3949	3.3987