

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	12 Setiembre 16	13 Setiembre 16	14 Setiembre 16	15 Setiembre 16	16 Setiembre 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	5 189,0	5 054,5	4 302,3	3 742,2	3 236,4
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)	50,0 200,0 100,0 100,0 234,0 801,0 322,3 241,0 178 d 360 d 82 d 542 d	100,0 100,0 415,0 415,0 369 d 91 d	50,0 100,0 217,0 321,4 540 d 176 d	50,0 100,0 203,0 193,4 357 d 175 d	50,0 100,0 193,4 175 d 4,49 4,49 4,50 4,54 4,49 4,51
Propuestas recibidas	4,34 4,70 4,34 4,86	4,75 4,40	4,94 4,49	4,72 4,49	4,75 4,54
Plazo de vencimiento	Máxima	Máxima	Máxima	Máxima	Máxima
Tasas de Inter Mínima	4,50 4,80 4,43 4,99	4,80 4,43	4,99 4,50	4,75 4,54	4,75 4,54
Máxima	4,49 4,75 4,41 4,92	4,77 4,41	4,96 4,49	4,74 4,51	4,74 4,51
Promedio					
Saldo	26 327,9	26 527,9	26 677,9	26 827,9	26 827,9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 06 de octubre de 2016	510,1		510,1		510,1
Vencimiento de CD BCRP del 19 al 23 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 19 al 23 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 19 al 23 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 19 al 23 de setiembre de 2016	0,0		0,0		0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	991,0 900,1 991,0 1221,2	999,7 261,2 900,1 1163,7 261,2 1455,8	800,1 1000,0 886,0 1416,6	794,5 800,0 794,5 1235,5	799,9 800,0 1 025,0
Propuestas recibidas	1 d 1 d	1 d 7 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d
Plazo de vencimiento	4,00 4,10	4,10 4,20 4,05	4,05 4,14	4,10 4,14	4,15 4,15
Tasas de Inter Mínima	4,25 4,20	4,25 4,25 4,20	4,25 4,19	4,25 4,19	4,24 4,24
Máxima	4,21 4,18	4,23 4,23 4,16	4,24 4,15	4,24 4,16	4,20 4,20
Promedio					
Saldo	1 891,1 1 891,1 1 891,1	2 161,0	2 061,3 1 800,1 1 800,1	1 855,7	1 061,1 799,9 1 061,1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 19 de Setiembre de 2016					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 19 al 23 de setiembre de 2016					
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	1 300,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 15 Diciembre de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 19 al 23 de setiembre de 2016	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	0,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de Coloc - BN del 19 al 23 de setiembre de 2016	0,0		0,0		0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas		200,6			100,0
Plazo de vencimiento		62 d			61 d
Tasas de Inter Mínima		0,00			0,50
Máxima		0,50			0,50
Promedio		0,20			0,50
Saldo	400,0	600,0	600,0	600,0	700,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 22 de setiembre de 2016	100,0		100,0		100,0
Vencimiento de CDR BCRP del 19 al 23 de setiembre de 2016	0,0		0,0		100,0
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 19 al 23 de setiembre de 2016	0,0		0,0		0,0
x. Compra con compromiso de Reconpra 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	7 900,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Repo Expansión del 19 al 23 de setiembre de 2016	0,0		0,0		0,0
xi. Compra con compromiso de Reconpra 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	4 804,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017	243,0		243,0		243,0
Vencimiento de Repo Sustitución del 19 al 23 de setiembre de 2016	0,0		0,0		0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas		54,0			114,0
Plazo de vencimiento		62 d			62 d
Tasas de Inter Mínima		0,00			0,55
Máxima		0,34			0,34
Promedio		0,34			0,34
Saldo	1 931,6	1 946,6	1 846,6	1 846,6	1 846,6
Próximo vencimiento de SC-Venta el 19 de Setiembre de 2016	40,0		159,0		159,0
Vencimiento de SC - Venta del 19 al 23 de setiembre de 2016	100,0		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)		0,0		0,0	965,6
Tipo de cambio promedio					0,0
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	2 847,9	2 493,5	2 352,2	1 997,7	2 336,5
4. Operaciones monetarias del BCR por el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
i. Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0133%	0,0132%	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%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés	275,3	23,0	151,4	256,6	705,6
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	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	2 572,6	2 470,5	2 200,8	1 741,1	1 630,9
e. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	8 788,1	8 817,2	8 704,5	8 699,3	8 597,3
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,8	7,8	7,7	7,7	7,8
g. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 507,4	3 448,0	3 358,9	3 264,0	3 162,0
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,1	3,2	3,0	2,9	2,8
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	490,0	534,0	583,0	627,0	715,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	152,0	150,0	150,0	215,0	101,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,50/0,50/0,50	0,50/0,50/0,50	0,50/0,50/0,50	0,50/0,50/0,50	0,50/0,50/0,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP - CDBCRP-NR y CDV	361,5	0,0	120,0	4,0	4,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)	50,0 / 4,85			100,0 / 4,48	
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)					
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	76,5	-14,7	2,2	-35,7	-31,0
Flujo de la posición contable = a + b1i - c1i + e + f + g	100,0	12,1	13,7	-13,4	2,3
a. Mercado spot con el público	112,8	14,8	94,2	10,8	46,2
i. Compras	304,5	236,0	265,4	265,6	240,0
ii. (c) Ventas	191,7	219,2	171,2	255,1	193,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-14,2	24,2	-210,1	71,8	-160,6
i. Placadas	129,7	114,7	219,3	186,5	299,2
ii. (c) Vencidas	143,9	90,5	429,4	114,9	459,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	9,5	53,2	-76,6	61,8	-128,8
i. Placadas	191,0	149,2	105,4	105,4	135,6
ii. (c) Vencidas	181,5	87,0	130,6	43,8	284,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	268,3	198,8	294,2	341,0	306,6
ii. A futuro	0,0	10,0	15,0	3,0	12,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	24,5	-6,7	-49,2	-49,2	-239,4
i. Compras	186,0	73,4	15,2	12,7	216,4
ii. (c) Ventas	141,5	80,1	428,0	106,9	455,8
f. Efecto de Opciones	0,3	2,1	-5,9	-1,9	-1,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,2	0,5	60,4	-30,4	-0,1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datarec)	3,3848	3,4027	3,4130	3,3952	3,3857
(*) Datos preliminares					