

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	26 Setiembre 16	27 Setiembre 16	28 Setiembre 16	29 Setiembre 16	30 Setiembre 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 050,9	2 352,6	2 696,1	2 724,6	2 286,7
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	37,2		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	37,2		169,0	124,6	
Tasas de Inter Mínima	164 d		529 d	343 d	
Máxima	4,50		4,85	4,85	
Promedio	4,75		4,85	4,72	
Saldo	4,60		4,85	4,69	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 06 de octubre de 2016	27 215,1	27 215,1	27 245,1	27 275,1	27 275,1
Vencimiento de CD BCRP entre el 3 y el 7 de octubre de 2016	510,1		510,1	510,1	510,1
Saldo	0,0		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	600,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 5 de Diciembre de 2016	200,0		200,0		300,0
Vencimiento de Repo BCRP entre el 3 y el 7 de octubre de 2016	200,0		200,0		
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 entre el 3 y el 7 de octubre 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 entre el 3 y el 7 de octubre de 2016	0,0		0,0		0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 213,9	1 232,4	1 600,2	1 800,0	899,7
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de Inter Mínima	3,78	3,74	3,98	4,00	3,98
Máxima	3,79	4,24	4,24	4,25	4,25
Promedio	3,78	3,96	4,19	4,13	4,16
Saldo	850,0	1 292,4	1 600,2	1 800,0	899,7
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 3 de Octubre de 2016	850,0		1 600,2		899,7
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 3 y el 7 de octubre de 2016	850,0		1 600,2		899,7
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 entre el 3 y el 7 de octubre 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 entre el 3 y el 7 de octubre de 2016	0,0		0,0		0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 28 de octubre de 2016	100,0		100,0		100,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 3 y el 7 de octubre de 2016	100,0		100,0		100,0
ix. Compra con compromiso de Recompra 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 Regular entre el 3 y el 7 de octubre de 2016	0,0		0,0		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	7 900,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Repo Expansión entre el 3 y el 7 de octubre de 2016	0,0		0,0		0,0
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	4 804,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017	243,0		243,0		243,0
Vencimiento de Repo Sustitución entre el 3 y el 7 de octubre de 2016	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	693,6	665,0	665,0	665,0	965,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 3 de Octubre de 2016	28,6		165,0		165,0
Vencimiento de SC - Venta entre el 3 y el 7 de octubre de 2016	28,6		0,0		165,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
Compras de BTP					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 163,7	1 060,2	1 065,9	894,6	1 387,0
4. Operaciones monetarias del BCR por el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0134%	0,0134%	0,0134%	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					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	204,4	249,0	479,0	342,5	43,6
Tasa de interés	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	959,3	811,2	586,9	552,1	1 343,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	7 699,7	7 742,3	7 577,8	7 505,0	7 487,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,8	6,9	6,7	6,7	6,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 423,6	2 365,0	2 301,5	2 246,0	2 215,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,2	2,2	2,0	2,0	2,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 157,0	787,0	734,0	709,0	840,0
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\$)	0,0	5,0	15,0	70,0	70,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,0	0,45/0,45/0,45	0,45/0,45/0,45	0,45/0,45/0,45	0,45/0,45/0,45
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	149,0	51,0	9,0	20,0	20,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	18,0 / 4,53				20,0 / 4,54
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	23 setiembre 16	26 setiembre 16	27 setiembre 16	28 setiembre 16	29 setiembre 16
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	82,6	-68,8	48,8	-37,2	-27,3
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	5,7	-132,7	-102,7	-102,0	-102,0
a. Mercado spot con el público	21,6	-131,5	98,5	1,4	-129,7
i. Compras	271,3	146,0	269,4	234,3	256,3
ii (c) Ventas	249,7	170,5	170,9	232,9	386,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	145,0	125,3	52,4	-95,1	-136,2
i. Placadas	212,4	259,0	116,1	72,4	117,6
ii (c) Vencidas	67,3	133,7	63,7	167,5	253,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	67,5	64,6	97,0	-65,6	-102,2
i. Placadas	107,8	116,0	222,8	99,1	133,9
ii (c) Vencidas	40,1	53,4	125,8	154,7	236,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	365,6	148,7	274,6	283,4	508,9
ii. A futuro	35,0	5,0	5,0	3,0	3,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-43,2	-75,7	65,0	-14,5	8,6
i. Compras	20,0	52,3	158,7	158,7	230,2
ii (c) Ventas	63,2	127,9	59,6	154,2	221,7
f. Efecto de Opciones	-3,2	3,2	-3,2	20,2	20,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	-5,8	-5,3	6,0	89,9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datarec)	3,3552	3,3611	3,3701	3,3765	3,3893
(*) Datos preliminares					