

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	03 Octubre 16	04 Octubre 16	05 Octubre 16	06 Octubre 16	07 Octubre 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 827,1	2 248,8	2 061,3	2 789,4	3 817,7
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 BCR (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	30,0		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	67,6		182,2	151,0	
Tasas de interés	185,4		554,4	371,4	
Máxima	4,60		4,69	4,62	
Mínima	4,65		4,85	4,67	
Promedio	4,61		4,84	4,66	
Saldo	27 305,1	27 305,1	27 335,1	26 855,0	26 855,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de octubre de 2016	510,1		510,1		1 260,0
Vencimiento de CD BCRP del 10 al 14 de octubre de 2016	510,1		510,1		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1 500,0	1 300,0	2 000,0	1 900,0	500,0
Propuestas recibidas	2 150,0	2 300,1	3 057,0	2 856,0	900,0
Plazo de vencimiento	1,0	1,0	1,0	1,0	1,0
Tasas de interés	4,26	4,30	4,51	4,51	4,31
Máxima	4,51	4,50	4,51	4,51	4,51
Mínima	4,45	4,32	4,51	4,51	4,48
Promedio	4,45	4,32	4,51	4,51	4,48
Saldo	2 100,0	1 900,0	2 600,0	2 500,0	1 100,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 10 de octubre de 2016	1 500,0		2 000,0		500,0
Vencimiento de REPO BCRP del 10 al 14 de octubre de 2016	1 500,0		2 000,0		500,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 10 al 14 de octubre de 2016	0,0	0,0	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					
Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de CDV BCRP del 10 al 14 de octubre de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Mínima					
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 10 al 14 de octubre de 2016	0,0		0,0		0,0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Coloc - BN del 10 al 14 de octubre de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)		200,0			300,0
Propuestas recibidas		399,0			590,0
Plazo de vencimiento		62,0			61,0
Tasas de interés		-0,15			-0,25
Máxima		0,15			-0,09
Mínima		-0,02			0,30
Promedio		0,00			0,09
Saldo	600,0	800,0	800,0	800,0	1 300,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 28 de octubre de 2016	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0
Vencimiento de CDR BCRP del 10 al 14 de octubre de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Reconquista de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas		768,0			
Plazo de vencimiento		365,0			
Tasas de interés		4,75			
Máxima		4,80			
Mínima		4,77			
Promedio		4,77			
Saldo	14 920,1	14 920,1	14 920,1	14 920,1	14 920,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de Octubre de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Repo del 10 al 14 de octubre de 2016	0,0		0,0		0,0
x. Compra con compromiso de Reconquista de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Mínima					
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 10 al 14 de octubre de 2016	0,0		0,0		0,0
xi. Compra con compromiso de Reconquista de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Mínima					
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 10 al 14 de octubre de 2016	0,0		0,0		0,0
xii. Subasta de Swap Cambiaria Venta del BCR					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	800,0	800,0	800,0	800,0	866,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 21 de Octubre de 2016	500,0		500,0		500,0
Vencimiento de SC - Venta del 10 al 14 de octubre de 2016	0,0		0,0		0,0
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					
iii. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
L. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
Máxima					
Mínima					
Promedio					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
L. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Mínima					
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 10 al 14 de octubre de 2016	0,0		0,0		0,0
xiii. Subasta de Swap Cambiaria Compra del BCR					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	800,0	800,0	800,0	800,0	866,0
Próximo vencimiento de SC-Compra el 21 de Octubre de 2016	500,0		500,0		500,0
Vencimiento de SC - Compra del 10 al 14 de octubre de 2016	0,0		0,0		0,0
c. Operaciones de Cambio de Moneda Extranjera (CME)					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
iii. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
L. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
Máxima					
Mínima					
Promedio					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
L. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Mínima					
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 10 al 14 de octubre de 2016	0,0		0,0		0,0
xiv. Subasta de Swap Cambiaria Venta del BCR					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	800,0	800,0	800,0	800,0	866,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 21 de Octubre de 2016	500,0		500,0		500,0
Vencimiento de SC - Venta del 10 al 14 de octubre de 2016	0,0		0,0		0,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 317,1	3 348,8	4 031,3	4 659,4	3 817,7
4. Operaciones monetarias del BCR por el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0133%	0,0133%	0,0133%	0,0132%	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					
Tasa de interés	55,0	39,0	39,1	529,5	31,6
Tipo de cambio 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	3 262,1	3 309,8	4 682,2	4 274,9	3 786,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	7 266,1	7 722,5	7 725,1	7 925,9	8 377,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,3	6,9	6,9	7,1	7,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	1 983,0	1 980,0	2 522,8	2 788,2	2 930,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	2,2	2,2	2,3	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	317,0	508,0	1 356,0	1 881,0	1 901,0
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	4,25/4,25/4,25
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	10,0	10,0	13,0	13,0	13,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP - CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	20,0	0,0 / 0,5	0,5 / 0,5 / 0,5	0,50 / 0,50 / 0,50	0,50 / 0,50 / 0,50
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	20,0 / 4,60	0,0	0,0	68,0	17,0
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)				20,0 / 4,30	
				5,0 / 4,60	
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)					
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	77,9	-87,6	-34,1	-18,7	52,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f + g	45,6	-46,9	-6,9	0,3	-7,4
a. Mercado spot con el público					
i. Compras	138,5	-14,9	18,3	-20,5	11,9
ii. Ventas	395,7	190,5	272,9	213,3	255,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)					
i. Pacifadas	257,2	295,5	253,5	233,9	243,8
ii. Ventas	4,0	14,6	-32,1	-61,6	-86,3
c. Operaciones con el público (con y sin entrega)					
i. Pacifadas	115,1	71,7	86,9	174,0	209,3