

<b>BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU</b>			
<b>RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS</b>			
<b>(Millones de Soles)</b>			
	<b>14 Noviembre 16</b>	<b>15 Noviembre 16</b>	<b>16 Noviembre 16</b>
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>3 314,0</b>	<b>3 011,3</b>	<b>2 280,9</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>			
<b>a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR</b>			
<b>i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)</b>			
Propuestas recibidas	30,0		30,0
Plazo de vencimiento	106,0		141,0
Tasas de Interés Mínima	178,0		540,0
Máxima	4,15		4,60
Promedio	4,34		4,66
Saldo	4,33		4,63
Próximo vencimiento de CD BCRP el 21 de noviembre de 2016	26 104,2	26 104,2	25 984,2
Vencimiento de CD BCRP del 21 al 25 de Noviembre de 2016	150,0		375,0
<b>ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)</b>			
Propuestas recibidas	150,0		975,0
Plazo de vencimiento			
Tasas de Interés Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	999,0	999,0	999,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 05 de diciembre de 2016	300,0		300,0
Vencimiento de REPO BCRP del 21 al 25 de Noviembre de 2016			
<b>iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)</b>			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Interés Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR	0,0		0,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 21 al 25 de Noviembre de 2016	0,0		0,0
<b>iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)</b>			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Interés Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el	0,0		0,0
Vencimientos de CDV BCRP del 21 al 25 de Noviembre de 2016	0,0		0,0
<b>v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</b>			
Propuestas recibidas	500,0	500,0	500,0
Plazo de vencimiento	924,2	1 353,4	1 353,4
Tasas de Interés Mínima	1 d	1 d	1 d
Máxima	3,84	3,80	3,80
Promedio	4,00	3,98	3,98
Saldo	3,94	3,94	3,94
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	500,0	500,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 21 al 25 de Noviembre de 2016	500,0		0,0
<b>vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público</b>			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Interés Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	1 300,0	1 300,0	1 300,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 15 Diciembre de 2016	300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 21 al 25 de Noviembre de 2016	0,0		0,0
<b>vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación</b>			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Interés Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el	0,0		0,0
Vencimiento de Coloc - BN del 21 al 25 de Noviembre de 2016	0,0		0,0
<b>viii. Subasta de Certificados de Depósitos Resajustables del BCRP (CDR BCRP)</b>			
Propuestas recibidas	100,0		135,0
Plazo de vencimiento	60 d		60 d
Tasas de Interés Mínima	0,45		0,45
Máxima	0,45		0,45
Promedio	0,45		0,45
Saldo	1 605,0	1 605,0	1 605,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 05 de diciembre de 2016	100,0		200,0
Vencimiento de CDR BCRP del 21 al 25 de Noviembre de 2016	100,0		0,0
<b>ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)</b>			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Interés Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	14 237,1	14 237,1	14 237,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 16 de Junio de 2017	400,0		400,0
Vencimiento de Repo del 21 al 25 de Noviembre de 2016	0,0		0,0
<b>x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)</b>			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Interés Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	7 900,0	7 900,0	7 900,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017	300,0		300,0
Vencimiento de REPO Expansión del 21 al 25 de Noviembre de 2016			
<b>xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)</b>			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Interés Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	4 804,7	4 804,7	4 804,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017	243,0		243,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 21 al 25 de Noviembre de 2016	0,0		0,0
<b>xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP</b>			
Propuestas recibidas	300,0	200,0	
Plazo de vencimiento	1135,0	691,0	
Tasas de Interés Mínima	60 d	92 d	
Máxima	-0,41	-0,65	
Promedio	-0,17	-0,31	
Saldo	-0,29	-0,45	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de enero 2017	1 269,9	1 269,9	915,9
Vencimiento de SC - Venta del 21 al 25 de Noviembre de 2016	319,9		319,9
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</b>			
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0
iii. 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	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTP			
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>2 684,0</b>	<b>2 511,3</b>	<b>2 250,9</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0132%	0,0132%	0,0132%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%
c. Crédito por regularización monetaria en moneda nacional	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés	118,8	117,4	223,0
d. Depósitos Overnights en moneda nacional	118,8	117,4	223,0
Tasa de interés	3,00%	3,00%	3,00%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>2 565,2</b>	<b>2 393,9</b>	<b>2 027,9</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	8 344,3	8 399,6	8 260,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	125,3	125,3	125,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7,5	7,5	7,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3 162,8	3 110,5	3 042,8
e. Saldo de BTP	2,8	2,7	2,7
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 306,0	1 956,0	2 168,3
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,30/4,26
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	49,0	44,0	35,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,50/0,50/0,50	0,50/0,50/0,50	0,50/0,50/0,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	84,7	81,0	90,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	15,0 / 4,33		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	43,7 / 4,50	11,0 / 4,50	
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)			
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>11 noviembre 16</b>	<b>14 noviembre 16</b>	<b>15 noviembre 16</b>
Flujo de la posición global = a + b - i - c - j + e + f + g	83,3	-32,6	28,6
Flujo de la posición corriente = a + b - i - c - j + e + g	125,3	125,3	125,3
a. Mercado spot con el público	17,2	84,5	86,6
i. Compras	173,4	269,0	359,9
ii. (-) Ventas	156,2	184,5	273,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-40,5	-107,0	-216,9
i. Pactadas	11,6	81,7	180,3
ii. (-) Vencidas	52,1	188,7	397,2
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	137,2	91,1	-232,5
i. Pactadas	208,0	146,0	146,5
ii. (-) Vencidas	70,8	107,5	379,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	415,7	206,0	584,3
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	16,2	-122,4	-66,6
i. Compras	50,3	65,7	256,6
ii. (-) Ventas	34,1	178,1	393,4
f. Efecto de Opciones	-0,3	3,9	3,9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	246,7	118,3	-0,9
h. Crédito por regularización monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,4092	3,4217	3,4228
(*) Datos preliminares			