

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	21 Noviembre 16	22 Noviembre 16	23 Noviembre 16	24 Noviembre 16	25 Noviembre 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 265,9	1 136,0	1 239,9	1 443,5	1 248,7
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 BCR (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	30,0		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	102,0		102,0	102,0	
Tasas de Inter Mínima	4,29		4,63	4,40	
Máxima	4,31		4,67	4,40	
Promedio	4,30		4,65	4,40	
Saldo	25 639,2	25 639,2	25 069,2	25 099,2	25 099,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de diciembre de 2016	600,0		1 299,9		1 299,9
Vencimiento de CD BCRP del 28 de noviembre al 02 de diciembre de 2016	600,0		0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	700,0	550,0	300,0	200,0	400,0
Plazo de vencimiento	1 000,0	750,0	303,0	301,0	400,0
Tasas de Inter Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	4,80	4,82	4,83	4,84	4,30
Promedio	4,80	4,82	4,83	4,84	4,84
Saldo	1 699,0	1 549,0	1 299,0	1 199,0	1 399,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 28 de noviembre de 2016	700,0		300,0		400,0
Vencimiento de Repo BCRP del 28 de noviembre al 02 de diciembre de 2016	700,0		300,0		400,0
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	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 28 de noviembre al 02 de diciembre 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 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	0,0	0,0
Vencimientos de CDV BCRP del 28 de noviembre al 02 de diciembre 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 Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 28 de noviembre al 02 de diciembre de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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 28 de noviembre al 02 de diciembre 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	0,0	0,0
Vencimiento de Coloc - BN del 28 de noviembre al 02 de diciembre de 2016	0,0	0,0	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	1 505,0	1 505,0	1 505,0	1 505,0	1 505,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 05 de diciembre de 2016	200,0		200,0		200,0
Vencimiento de CDR BCRP del 28 de noviembre al 02 de diciembre de 2016	0,0		0,0		0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	14 237,1	14 237,1	14 237,1	14 237,1	14 237,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 16 de Junio de 2017	400,0		400,0		400,0
Vencimiento de REPO del 28 de noviembre al 02 de diciembre de 2016	0,0		0,0		0,0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansion)					
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 Expansion el 17 de Enero de 2017	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO Expansion del 28 de noviembre al 02 de diciembre de 2016	0,0		0,0		0,0
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitucion)					
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 Sustitucion el 26 de Mayo de 2017	243,0		243,0		243,0
Vencimiento de REPO Sustitucion del 28 de noviembre al 02 de diciembre de 2016	0,0		0,0		0,0
xii. Subasta de Swap Cambiara Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 055,9	1 055,9	1 055,9	920,9	920,9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de enero 2017	319,9		319,9		319,9
Vencimiento de SC - Venta del 28 de noviembre al 02 de diciembre de 2016	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					
Compras (millones de US\$)					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
Ventas (millones de US\$)					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 935,9	1 686,0	1 509,9	1 613,5	1 648,7
4. Operaciones monetarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0132%	0,0132%	0,0132%	0,0132%	0,0132%
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%
Depósitos Overnight en moneda nacional	282,9	225,5	314,4	340,9	532,8
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	1 653,0	1 625,5	1 195,5	1 272,6	1 115,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	8 091,0	8 185,6	7 873,5	7 839,7	7 762,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,2	7,3	7,0	6,9	6,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 798,5	2 749,2	2 681,6	2 632,6	2 571,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,5	2,6	2,4	2,3	2,3
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1 733,0	1 853,0	2 344,6	1 862,0	1 509,0
Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	4,254/3,04/2,6	4,254/3,04/2,5	4,254/3,04/2,6	4,354/3,35/4,35	4,354/3,35/4,35
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,50/0,50/0,50	90,2	0,50 / 0,50 / 0,50	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	156,0	30,0 / 4,33	335,0	60,0	45,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					30,0 / 4,40
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	16 noviembre 16	21 noviembre 16	22 noviembre 16	23 noviembre 16	24 noviembre 16
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	-45,1	-22,4	54,0	33,2	2,3
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	84,9	78,8	145,8	22,0	-112,4
a. Mercado spot con el público					
i. Compras	125,5	73,3	147,1	45,6	-40,7
ii. Ventas	233,6	298,1	462,1	272,2	180,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)					
i. Pactadas	-64,6	0,0	-19,6	-161,9	95,2
ii. Vencidas	93,0	117,1	130,4	104,2	130,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)					
i. Pactadas	-37,8	142,0	71,2	-163,1	-59,6
ii. Vencidas	147,7	243,2	243,2	143,2	71,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	253,4	279,0	308,0	494,5	276,0
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega					
i. Compras	18,6	-81,3	36,2	28,5	29,6
ii. Ventas	172,8	72,2	315,0	288,1	61,5
f. Efecto de Opciones	154,2	144,8	144,8	263,6	31,7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
i. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	0,0	0,0	-0,2	0,0	-0,6
Tasa de interés	-134,8	41,7	-1,8	-7,7	-45,4
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datacash)	3,4126	3,4172	3,4187	3,4261	3,4154