

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**  
(Millones de Soles)

	19 Diciembre 16	20 Diciembre 16	21 Diciembre 16	22 Diciembre 16	23 Diciembre 16
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>3.157,8</b>	<b>1.911,8</b>	<b>1.472,6</b>	<b>1.823,4</b>	<b>405,4</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	30,0		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	182,5		41,0	174,0	
Tasas de Inter Mínima	175 d		533 d	350 d	
Máxima	4,15		4,65	4,35	
Promedio	4,26		4,87	4,35	
Saldo	22.974,4	22.974,4	23.004,4	23.034,4	23.034,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de diciembre de 2016	100,0		100,0		100,0
Vencimiento de CD BCRP del 26 al 30 de diciembre de 2016	0,0		0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas		300,0		200,0	500,0
Plazo de vencimiento		725,0		470,0	1.348,0
Tasas de Inter Mínima		192 d		192 d	3 d
Máxima		5,51		5,57	5,21
Promedio		5,86		5,86	5,21
Saldo		999,0		1.199,0	2.399,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 08 de mayo de 2017		399,0		0,0	399,0
Vencimiento de REPO BCRP del 26 al 30 de diciembre de 2016		300,0		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					
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 26 al 30 de diciembre 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					
Vencimientos de CDV BCRP del 26 al 30 de diciembre de 2016	0,0		0,0		0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1.499,9	700,0	300,0	200,0	
Plazo de vencimiento	2.157,5	705,0	332,5	424,0	
Tasas de Inter Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	
Máxima	3,70	3,50	3,65	3,65	
Promedio	4,00	4,18	3,95	3,95	
Saldo	3,93	3,87	3,70	3,70	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	2.200,0	500,0	500,0	200,0	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 26 al 30 de diciembre de 2016	1.500,0	500,0	500,0		
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas	200,0	300,0	300,0		300,0
Plazo de vencimiento	1.164,0	1.429,0	1.429,0		1.464,0
Tasas de Inter Mínima	365 d	365 d	365 d		368 d
Máxima	5,85	5,98	5,98		6,06
Promedio	6,50	6,10	6,10		6,16
Saldo	6,09	5,99	5,99		6,11
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 08 de junio de 2017	1.000,0	1.000,0	1.300,0	1.300,0	1.600,0
Vencimiento de Coloc-TP del 26 al 30 de diciembre de 2016	0,0		0,0		300,0
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					
Vencimiento de Coloc - BN del 26 al 30 de diciembre 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	805,0	805,0	805,0	805,0	805,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 10 de enero de 2017	255,0		255,0		255,0
Vencimiento de CDR BCRP del 26 al 30 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 Reco Regular el 16 de junio de 2017	400,0		400,0		400,0
Vencimiento de REPO del 26 al 30 de diciembre 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 del 26 al 30 de diciembre de 2016					
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 del 26 al 30 de diciembre 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	1.120,9	1.120,9	1.120,9	1.120,9	930,3
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de enero 2017	319,9		319,9		285,1
Vencimiento de SC - Venta del 26 al 30 de diciembre de 2016	0,0		0,0		0,0
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</b>					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
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
Compras de BTP					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>1.827,8</b>	<b>1.511,8</b>	<b>1.442,6</b>	<b>1.793,4</b>	<b>1.905,4</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0133%	0,0133%	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					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnights en moneda nacional	471,8	166,1	29,4	156,0	154,1
Tasa de interés	3,00%	3,00%	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>1.356,0</b>	<b>1.345,7</b>	<b>1.413,2</b>	<b>1.637,4</b>	<b>1.751,3</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	8.315,1	8.452,8	8.234,8	8.139,4	8.018,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,2	7,4	7,2	7,2	7,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2.951,1	2.877,9	2.877,9	2.801,5	2.755,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,6	2,7	2,5	2,5	2,4
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1.482,0	1.353,0	1.506,0	1.263,0	1.165,5
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio					
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	4.25/4.30/4.26	4.25/4.25/4.25	4.25/4.25/4.25	4.25/4.55/4.37	4.25/4.85/4.61
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,0			0,0	0,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	105,1	176,1	190,5	303,6	305,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	54,0 / 4,34				
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>16 diciembre 16</b>	<b>19 diciembre 16</b>	<b>20 diciembre 16</b>	<b>21 diciembre 16</b>	<b>22 diciembre 16</b>
Flujo de la posición global = a + b - c - j + e + f + g	-61,9	46,9	13,4	-3,9	84,5
Flujo de la posición contable = a - b - j - c - i + e + g	9,6	21,3	99,6	40,5	86,2
a. Mercado spot con el público	-17,9	6,3	117,8	53,5	101,6
i. Compras	235,5	226,6	323,3	325,4	383,9
ii. Ventas	251,4	220,5	220,5	271,9	292,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	52,2	-27,3	-115,7	37,6	48,1
i. Futuros	36,6	127,2	127,2	162,9	132,3
ii. (c) Vencidas	44,4	154,5	65,3	84,8	84,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	93,8	-73,2	-25,3	69,7	50,1
i. Futuros	165,9	120,2	151,9	212,9	212,5
ii. (c) Vencidas	72,1	193,4	159,3	82,2	162,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	299,8	287,0	313,0	467,4	470,7
ii. A futuro	18,0	0,0	5,0	0,0	13,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	58,3	70,2	70,2	70,4	70,4
i. Compras	68,9	190,8	141,3	81,1	142,5
ii. (c) Ventas	10,6	120,6	144,2	57,1	72,1
f. Efecto de Opciones	-29,9	-20,3	4,1	-0,3	0,3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-3,1	-16,3	-11,7	-20,1	-8,0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,4053	3,4065	3,4025	3,3952	3,3967
(*) Datos preliminares					