

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

(Millones de Soles)

	26 Diciembre 16	27 Diciembre 16	28 Diciembre 16	29 Diciembre 16	30 Diciembre 16
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>868,8</b>	<b>1 406,7</b>	<b>2 091,5</b>	<b>2 644,8</b>	<b>3 015,9</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				
Plazo de vencimiento	171 d				
Tasas de interés: Mínima	4,28				
Máxima	4,50				
Promedio	4,40				
Saldo	23 064,4	22 864,4	22 864,4	22 864,4	22 864,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 05 de enero de 2017	100,0	140,0	140,0	140,0	140,0
Vencimiento de CD BCRP entre el 02 y el 06 de enero, 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	500,0 100,0 200,0 400,0	500,0 100,0 100,0 300,0 300,0	500,0 300,0	200,0	200,0
Propuestas recibidas	1405,0 213,0 755,0 515,0	1485,0 410,0 480,0 330,0 1090,0 300,0	1090,0	715,0	515,0
Plazo de vencimiento	1 d 7 d 1 d	1 d 7 d 7 d 1 d 7 d 1 d	1 d	1 d	7 d
Tasas de interés: Mínima	5,37 5,41 5,70 5,46	5,39 5,51 5,55 5,51 5,35 4,51	4,26	4,25	4,35
Máxima	5,37 5,41 5,70 5,74	5,40 5,51 5,55 5,51 5,35 5,16	4,85	4,25	4,70
Promedio	5,37 5,41 5,70 5,64	5,40 5,51 5,55 5,51 5,35 4,84	4,47	4,25	4,49
Saldo	2 399,0	2 799,0	2 699,0	2 099,0	2 099,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 02 de enero de 2017	1000,0	900,0	800,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 02 y el 06 de enero, 2017	1 000,0	900,0	800,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: 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 entre el 02 y el 06 de enero, 2017	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: 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
Vencimiento de CDV BCRP entre el 02 y el 06 de enero, 2017	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: 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 entre el 02 y el 06 de enero, 2017	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 interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 08 de junio de 2017	300,1	300,1	300,1	300,1	300,1
Vencimiento de Coloc-TP entre el 02 y el 06 de enero, 2017	0,0	0,0	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 interés: 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 entre el 02 y el 06 de enero, 2017	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 interés: 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	255,0	255,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 02 y el 06 de enero, 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: 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	400,0	400,0
Vencimiento de REPO entre el 02 y el 06 de enero, 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: 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	300,0	300,0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 02 y el 06 de enero, 2017					
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: 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	243,0	243,0
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 02 y el 06 de enero, 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	890,3	820,3	513,5	513,5	513,5
Próximo vencimiento de SC Venta el 10 de enero 2017	285,1	175,1	123,3	110,3	110,3
Vencimiento de SC - Venta entre el 02 y el 06 de enero, 2017	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\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipos de cambio promedio					
iii. Compras (millones de US\$)					
Tipos 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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
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>2 038,8</b>	<b>2 806,7</b>	<b>2 891,5</b>	<b>2 844,8</b>	<b>3 015,9</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0133%	0,0134%	0,0134%	0,0135%	0,0134%
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	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
Tasa de interés					
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>1 795,8</b>	<b>1 817,7</b>	<b>1 836,5</b>	<b>1 136,8</b>	<b>1 280,1</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	1 572,5	1 546,0	1 549,5	1 739,5	1 739,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,9	7,0	6,9	6,8	6,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 631,7	2 672,3	2 596,4	2 515,4	2 496,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,3	2,3	2,3	2,2	2,2
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 238,5	1 075,5	687,0	634,0	634,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,70 / 4,85 / 4,80	4,50 / 0,0 / 4,84	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	0,0	0,0	26,0	26,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				0,55 / 0,55 / 0,55	0,55 / 0,55 / 0,55
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	216,3	503,6	217,6	173,0	173,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		7,0 / 4,5			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				25,0 / 4,41	25,0 / 4,41
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>23 diciembre 16</b>	<b>26 diciembre 16</b>	<b>27 diciembre 16</b>	<b>28 diciembre 16</b>	<b>29 diciembre 16</b>
Flujo de la posición notal - a + b - c - e + f + g	-64,5	-21,5	12,1	-126,5	-126,5
Flujo de la posición contable - a + b - c - e + f + g	73,0	-8,2	-23,1	-76,6	-63,4
a. Mercado spot con el público	53,9	-3,0	-5,1	-105,2	-46,0
i. Compras	318,4	118,8	227,4	223,1	249,9
ii. Ventas	265,1	147,8	232,4	328,2	295,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-71,4	-4,8	-116,3	-107,2	-65,6
i. Pasivos	73,3	6,1	148,0	155,3	126,2
ii. Ventas	144,7	10,9	31,7	258,0	185,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	9,6	-30,2	48,1	-149,1	-250,8
i. Pasivos	152,7	4,2	128,3	153,5	210,8
ii. Ventas	143,2	34,7	80,2	302,6	461,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	358,2	64,5	194,6	309,7	236,0
ii. A futuro	26,0	17,0	0,0	3,0	21,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	26,9	3,7	46,1	109,4	294,1
i. Compras	142,2	74,6	74,6	293,2	452,5
ii. Ventas	115,3	1,8	28,6	183,8	158,4
f. Elección de Opciones	-0,7	-0,3	-0,8	-0,8	-0,8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-64,6	-0,1	-47,9	-125,0	-35,8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,3847	3,3894	3,3801	3,3616	3,3542
(*) Datos preliminares.					