

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU						
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS						
(Millones de Soles)						
	14 Marzo 16	15 Marzo 16	16 Marzo 16	17 Marzo 16	18 Marzo 16	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	4 241,1	3 756,8	3 685,8	2 216,8	1 470,7	
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 BCRP (CD BCRP)						
Propuestas recibidas	30,0			30,0		
Plazo de vencimiento	178 d			121,0		
Tasas de Inter Mínima	4,75			5,40		
Máxima	4,75			5,06		
Promedio	4,75			5,09		
Saldo	15 795,3	15 795,3	15 925,3	15 855,3	15 855,3	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 23 de Marzo de 2016						15,0
Vencimiento de CD BCRP entre el 21 y el 23 de Marzo de 2016						15,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de Inter Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0	
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 26 de Mayo de 2016						300,0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 21 y el 23 de Marzo de 2016						500,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de Inter Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 26 de Mayo de 2016						1 600,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 21 y el 23 de Marzo de 2016						400,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de Inter Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	160,0	160,0	160,0	160,0	160,0	
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 20 Mayo de 2016						160,0
Vencimiento de CDV BCRP entre el 21 y el 23 de Marzo de 2016						160,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	499,9	1 500,0	500,0	1 388,0	500,0	
Propuestas recibidas	1 240,0	1 615,9	1 089,0	1 388,0	1 118,8	
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	
Tasas de Inter Mínima	4,16	4,10	3,10	4,00	4,15	
Máxima	4,20	4,25	4,20	4,20	4,24	
Promedio	4,19	4,21	4,18	4,19	4,23	
Saldo	1 999,9		1 892,0	1 888,3	500,0	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 23 de Marzo de 2016						
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 21 y el 23 de Marzo de 2016						
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de Inter Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	2 500,0	2 500,0	2 500,0	2 500,0	2 500,0	
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 13 Mayo de 2016						2 500,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 21 y el 23 de Marzo de 2016						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	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0	
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016						600,0
Vencimiento de Coloc - BN entre el 21 y el 23 de Marzo de 2016						300,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de Inter Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	8 388,0	8 388,0	8 388,0	8 388,0	8 388,0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 21 de Marzo de 2016						8 388,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 21 y el 23 de Marzo de 2016						265,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de Inter Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	14 300,0	14 300,0	14 300,0	14 300,0	14 300,0	
Próximo vencimiento de Repo Regular el 14 de Abril de 2016						14 300,0
Vencimiento de REPO entre el 21 y el 23 de Marzo de 2016						300,0
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						7 900,0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 21 y el 23 de Marzo de 2016						0,0
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						4 804,7
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 21 y el 23 de Marzo de 2016						243,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP						
Propuestas recibidas			300	90		300,0
Plazo de vencimiento			926	90	10	898,0
Tasas de Inter Mínima			89,4	89,4	92,4	94,4
Máxima			0,50	0,69	0,65	0,09
Promedio			0,54	0,75	0,65	0,75
Saldo	27 903,7	27 819,4	28 209,4	27 919,4	28 219,3	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 21 de Marzo de 2016						1 748,8
Vencimiento de SC - Venta entre el 21 y el 23 de Marzo de 2016						3 086,5
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	-101,3	-67,4	-114,9	
i. Compras (millones de US\$)						
Tipo de cambio promedio						
ii. Ventas (millones de US\$)			30,0	20,0	34,0	
Tipo de cambio promedio			3,3782	3,3684	3,3786	
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						
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2 211,2	1 874,8	1 666,2	1 619,4	1 355,9	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones						
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)						
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0128%	0,0128%	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	161,5	188,2	217,8	432,0	528,7	
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	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	2 049,6	1 686,6	1 448,4	1 874,4	1 827,4	
s Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 295,8	4 295,8	4 295,8	4 295,8	4 295,8	
t Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,9	7,9	7,7	7,6	7,5	
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 206,1	2 986,5	2 901,7	2 810,9	2 700,7	
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,0	3,0	2,8	2,7	2,6	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP						
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 089,0	868,0	701,0	1 496,0	1 293,0	
Tasas de Inter. Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,30/4,25	4,25/4,30/4,29	4,25/4,40/4,32	4,40/5,30/5,00	5,25/5,30/5,27	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	204,0	179,0	154,0	184,0	188,9	
Tasas de Inter. Mínima / Máxima / Promedio	0,380/0,380/0,38	0,380/0,380/0,38	0,380/0,380/0,38	0,380/0,380/0,38	0,380/0,380/0,38	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	5,7	27,0	10,0	0,0	
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				6,0 / 5,40		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)						
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)						
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	11 marzo 16	14 marzo 16	15 marzo 16	16 marzo 16	17 marzo 16	
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	30,6	7,1	-56,0	-27,3	24,8	
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + g	46,2	117,1	54,3	-33,1	6,7	
a. Mercado spot con el público	-15,6	105,6	44,2	-66,9	-2,3	
i. Compras	307,7	483,0	259,8	274,6	302,9	
ii. (-) Ventas	323,3	377,4	215,6	341,5	305,2	
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	189,8	-424,3	-123,3	-59,1	51,6	
i. Pactadas	276,0	206,5	13,2	60,9	105,2	
ii. (-) Ventas	86,2	630,9	136,6	119,9	53,7	
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	41,5	-347,7	-44,6	-55,0	-55,0	
i. Pactadas	300,1	220,7	208,1	358,3	298,4	
ii. (-) Ventas	258,5	568,3	252,8	310,1	253,3	
d. Operaciones cambiarias interbancarias	832,1	528,2	517,0	718,7	1260,1	
ii. Al contado	0,0	0,0	0,0	0,0	38,0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	240,4	-51,3	123,8	206,3	206,3	
i. Compras	245,4	266,7	246,6	246,6	254,6	
ii. (-) Ventas	5,0	618,0	125,3	56,3	46,2	
f. Efecto de Opciones	13,7	55,5	-6,7	-2,4	-3,2	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-183,8	-86,5	-22,3	148,2	-74,9	
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera						
Tasa de interés						
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3850	3,3521	3,3496	3,3773	3,3481	
(*) Datos preliminares						