BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	21 Marzo 16	22 Marzo 16	23 Marzo 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**1 273,9**	**908,5**	**654,9**
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)	30,0		30,0
Propuestas recibidas	53,5		113,9
Plazo de vencimiento	171 d		533 d
Tasas de inter Mínima	4,70		5,38
Máxima	4,75		5,42
Promedio	4,74		5,41
Saldo	15 885,3	15 885,3	15 900,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de Abril de 2016			1 171,4
Vencimiento de CD BCRP entre el 28 de Marzo y el 1 de Abril de 2016			0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	450,0	100 100 500	1 000,0
Propuestas recibidas	1 335,0	350 350 825	2 405,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d 1 d 1 d	5 d
Tasas de inter Mínima	4,93	5,31 5,31 5,83	5,61
Máxima	4,95	5,31 5,31 5,83	5,70
Promedio	4,93	5,31 5,31 5,83	5,61
Saldo	750,0	1 000,0	1 300,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 28 de Marzo de 2016			1 000,0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 28 de Marzo y el 1 de Abril de 2016			1 000,0
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
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 26 de Mayo de 2016			400,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 28 de Marzo y el 1 de Abril de 2016			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	160,0	160,0	160,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 20 mayo de 2016			160,0
Vencimientos de CDV BCRP entre el 28 de Marzo y el 1 de Abril de 2016			0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo			
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo			
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 28 de Marzo y el 1 de Abril 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
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 13 Mayo de 2016			300,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 28 de Marzo y el 1 de Abril de 2016			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	600,0	600,0	600,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el de 20 Mayo de 2016			300,0
Vencimiento de Coloc - BN entre el 28 de Marzo y el 1 de Abril de 2016			0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			70,0
Propuestas recibidas			70,0
Plazo de vencimiento			92 d
Tasas de inter Mínima			0,75
Máxima			0,75
Promedio			0,75
Saldo	8 388,0	8 123,0	8 123,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 29 de Marzo de 2016			167,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 28 de Marzo y el 1 de Abril de 2016			167,0
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
Próximo vencimiento de Repo Regular el 14 de Abril de 2016			300,0
Vencimiento de REPO entre el 28 de Marzo y el 1 de Abril de 2016			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
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 17 de Enero de 2017			300,0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 28 de Marzo y el 1 de Abril 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
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 26 de Mayo de 2017			243,0
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 28 de Marzo y el 1 de Abril de 2016			0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	135 599,9 550 300	600,0	750,0
Propuestas recibidas	185 1415,0 978 477	1 180,0	1 091,0
Plazo de vencimiento	60 d 84 d 85 d 92 d	92 d	92 d
Tasas de inter Mínima	0,75 0,35 0,50 0,69	0,49	0,49
Máxima	0,75 0,75 0,75 0,70	0,69	0,64
Promedio	0,75 0,60 0,68 0,69	0,62	0,58
Saldo	28 055,4	28 055,4	28 055,4
Próximo vencimiento de SC-Venta el 28 de Marzo de 2016			985,0
Vencimiento de SC - Venta entre el 28 de Marzo y el 1 de Abril de 2016			1 615,1
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-91,9	0,0	0,0
i. Compras (millones de US$)			
Tipo de cambio promedio			
ii. Ventas (millones de US$)	27,0		
Tipo de cambio promedio	3,4033		
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US$)			
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público			
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público			
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR			
ii. Compras de BTP			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**1 602,1**	**1 608,5**	**1 554,9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0133%	0,0132%	0,0133%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	508,3	492,4	491,4
Tasa de interés	3,00%	3,00%	3,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 093,8**	**1 116,1**	**1 063,5**
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	**4 295,8**	**4 295,8**	**4 295,8**
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,2	7,3	7,1
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 610,5	2 368,4	2 311,7
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,4	2,5	2,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 322,0	661,0	1 226,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,90/5,30/5,17	5,35/5,55/5,41	5,35/5,60/5,49
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	28,9	28,9	52,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,38/0,38/0,38	0,38/0,43/0,39	0,38/0,43/0,39
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	0,0	12,9
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)			12,9 / 5,39
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**18 marzo 16**	**21 marzo 16**	**22 marzo 16**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	110,0	51,9	33,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	153,9	0,9	13,9
a. Mercado spot con el publico	10,0	42,3	-17,3
i. Compras	376,5	232,3	328,5
ii (-) Ventas	366,5	190,0	345,8
b. Compras forward al publico (con y sin entrega)	-145,3	-17,1	-235,6
i. Pactadas	83,5	38,0	10,9
ii (-) Vencidas	228,8	55,1	246,5
c. Ventas forward al publico (con y sin entrega)	-10,2	-112,6	-254,3
i. Pactadas	280,2	225,7	316,4
ii (-) Vencidas	290,4	338,3	570,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	951,9	740,1	1229,1
ii. A futuro	0,0	0,0	35,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	190,2	292,0	364,0
i. Compras	288,3	327,0	563,1
ii (-) Ventas	98,1	35,1	199,0
f. Efecto de Opciones	2,2	1,0	1,7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	104,4	-95,7	-9,7
h. Credito por regulacion monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3755	3,3952	3,4112
(*) Datos preliminares			

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera