

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	13 Junio 16	14 Junio 16	15 Junio 16	16 Junio 16	17 Junio 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 825,8	4 009,2	3 567,0	3 024,0	1 721,1
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	100	100	30	200
Plazo de vencimiento	146	354	367	120	403
Tasas de Inter	185 d	185 d	184 d	357 d	357 d
Mínima	4,58	4,66	4,50	4,78	4,75
Máxima	4,69	4,70	4,50	4,78	4,98
Promedio	4,64	4,69	4,50	4,78	4,88
Saldo	15 623,2	15 823,2	16 053,2	16 283,2	15 953,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 24 de Junio de 2017	330,0	330,0	330,0	330,0	80,0
Vencimiento de CD BCRP entre el 20 y el 24 de Junio de 2016	330,0	330,0	330,0	330,0	80,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	800,0	800,0	800,0	800,0	500,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 30 de setiembre de 2016	300,0	300,0	300,0	300,0	200,0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 20 y el 24 de Junio de 2016	300,0	300,0	300,0	300,0	0,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Reco 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 Reco Especial - CDR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Reco Especial - CDR entre el 20 y el 24 de Junio 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
Vencimiento de CDV BCRP entre el 20 y el 24 de Junio de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 199,9	1 400,0	1 400,0	1 123,2	
Plazo de vencimiento	1 243,6	2 100,6	1 490,2	1 123,2	
Tasas de Inter	1 d	1 d	1 d	1 d	
Mínima	4,00	4,00	4,05	4,05	
Máxima	4,20	4,17	4,20	4,22	
Promedio	4,05	4,12	4,11	4,12	
Saldo	1 199,9	1 400,0	1 400,0	1 123,2	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	1 199,9	1 400,0	1 400,0	1 123,2	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 20 y el 24 de Junio de 2016	1 199,9	1 400,0	1 400,0	1 123,2	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	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 5 Julio de 2016	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 20 y el 24 de Junio de 2016	800,0	800,0	800,0	500,0	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 entre el 20 y el 24 de Junio 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	3 175,0	3 175,0	3 175,0	3 175,0	3 175,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 23 de Junio de 2016	70,0	70,0	70,0	70,0	70,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 20 y el 24 de Junio de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas	300,0				
Plazo de vencimiento	1 990,0				
Tasas de Inter	730 d				
Mínima	4,78				
Máxima	5,18				
Promedio	4,92				
Saldo	16 000,0	16 000,0	16 000,0	16 000,0	16 000,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 27 de Junio de 2016	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO entre el 20 y el 24 de Junio de 2016	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 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	300,0	300,0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 20 y el 24 de Junio de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	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 Sustitucion el 26 de Mayo de 2017	243,0	243,0	243,0	243,0	243,0
Vencimiento de REPO Sustitucion entre el 20 y el 24 de Junio de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	290,0	95,0			
Plazo de vencimiento	290,0	442,0			
Tasas de Inter	92 d	92 d			
Mínima	0,03	0,29			
Máxima	0,69	0,34			
Promedio	0,48	0,32			
Saldo	17 296,3	17 296,3	16 211,6	16 056,6	15 876,6
Próximo vencimiento de SC-Venta el 20 de Junio de 2016	96,6	30,0	30,0	30,0	250,0
Vencimiento de SC - Venta entre el 20 y el 24 de Junio de 2016	126,6	30,0	30,0	30,0	910,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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 v BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP v 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	2 595,9	2 409,2	1 937,0	1 970,8	1 721,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	0,0136%	0,0135%	0,0136%	0,0135%	0,0126%
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	253,2	136,4	135,3	230,2	525,4
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	2 342,7	2 272,8	1 801,7	1 740,6	1 195,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	8 276,3	8 324,3	8 153,6	6 886,1	7 977,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,9	7,9	7,8	7,6	7,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 227,3	3 276,1	3 076,0	1 797,6	2 939,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,1	3,1	2,9	1,7	2,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	735,0	663,0	770,5	878,5	1 016,5
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	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\$)	58,0	205,0	325,0	165,0	165,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,40/0,40/0,40	0,40/0,40/0,40	0,40/0,45/0,41	0,40/0,45/0,41	0,40/0,45/0,41
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR v CDV	0,0	0,0	60,0	120,0	63,3
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			60,0 / 4,50	40,0 / 4,50	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				80,0 / 4,80	63,3 / 4,79
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	10 junio 16	13 junio 16	14 junio 16	15 junio 16	16 junio 16
Flujo de la posición global = a + b) - c) + e + f + g	113,6	-26,4	30,2	-213,4	161,3
Flujo de la posición contable = a + b) - c) + e + f + g	29,3	-39,3	87,9	23,3	139,3
a. Mercado spot con el público	42,4	-19,2	81,7	42,4	134,0
i. Compras	278,4	236,5	342,6	286,5	330,3
ii. (i) Ventas	236,0	254,7	250,7	244,1	196,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	125,6	-183,6	42,8	62,1	-72,1
i. Pactadas	186,5	121,4	111,5	223,9	194,7
ii. (i) Ventas	60,9	305,0	65,6	151,8	256,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	34,7	-451,5	101,0	-23,4	-139,2
i. Pactadas	114,8	267,8	139,1	169,0	128,5
ii. (i) Ventas	80,1	719,4	39,1	192,4	267,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	265,9	410,2	415,6	188,0	448,8
ii. A futuro	0,0	5,0	5,0	4,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	7,5	395,2	-24,7	31,1	5,8
i. Compras	61,5	695,0	651,0	161,8	265,3
ii. (i) Ventas	54,0	299,8	276,3	152,7	259,4
f. Saldo de Depósitos	-2,5	-64,7	0,5	-5,8	0,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-5,5	-172,2	0,4	-386,2	-45,6
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datarec)	3,3193	3,3301	3,3379	3,3174	3,3362
(*) Datos preliminares					