

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

| | 01 Agosto 16 | 02 Agosto 16 | 03 Agosto 16 | 04 Agosto 16 | 05 Agosto 16 |
|--|--------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP | 4 305,7 | 4 561,5 | 5 346,9 | 5 145,7 | 4 303,3 |
| 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 | 50,0 | | 50,0 | 200,0 | 290,0 |
| Plazo de vencimiento | 241,0 | | 296,0 | 549,0 | 458,0 |
| Tasas de Inter Mínima | 193 d | | 554 d | 197 d | 371 d |
| Máxima | 4,69 | | 4,90 | 4,86 | 4,30 |
| Promedio | 4,75 | | 4,90 | 5,00 | 4,30 |
| Saldo | 4,72 | | 4,90 | 4,82 | 4,30 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de agosto de 2016 | 21 053,2 | 21 053,2 | 21 597,2 | 22 137,2 | 22 337,2 |
| Vencimiento de CD BCRP del 08 al 12 de agosto de 2016 | | | | | 845,8 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores al 30 de Setiembre de 2016 | 1 000,0 | 1 000,0 | 1 000,0 | 1 000,0 | 800,0 |
| Vencimiento de REPO BCRP del 06 al 12 de agosto de 2016 | | | | | 200,0 |
| 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 del 06 al 12 de agosto 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 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Próximo vencimiento de CDV BCRP el 08 al 12 de agosto 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 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 08 al 12 de agosto de 2016 | | | | | 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 2 de Setiembre de 2016 | | | | | 300,0 |
| Vencimiento de Coloc-TP del 08 al 12 de agosto 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 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Próximo vencimiento de Coloc-BN el 08 al 12 de agosto de 2016 | | | | | 0,0 |
| viii. Subasta de Certificados de Depósitos Rescatables del BCRP (CDR BCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 1 743,0 | 1 743,0 | 1 458,0 | 1 458,0 | 1 458,0 |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP el 09 de agosto de 2016 | | | | | 50,0 |
| Vencimiento de CDR BCRP del 08 al 12 de agosto de 2016 | | | | | 50,0 |
| ix. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Regular) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 15 700,1 | 15 700,1 | 15 700,1 | 15 700,1 | 15 700,1 |
| Próximo vencimiento de Repo Regular el 19 de Agosto de 2016 | | | | | 500,0 |
| Vencimiento de REPO del 08 al 12 de agosto de 2016 | | | | | 0,0 |
| x. Compra con compromiso de Reconpra 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 |
| Vencimiento de REPO Expansión del 08 al 12 de agosto de 2016 | | | | | 0,0 |
| xi. Compra con compromiso de Reconpra 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 |
| Vencimiento de REPO Sustitución del 08 al 12 de agosto de 2016 | | | | | 0,0 |
| xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | | | | | |
| Propuestas recibidas | | 200,0 | 300,0 | | |
| Plazo de vencimiento | | 556,0 | 345,0 | | |
| Tasas de Inter Mínima | | 62 d | 61 d | | |
| Máxima | | -0,01 | 0,50 | | |
| Promedio | | 0,15 | 0,70 | | |
| Saldo | 6 562,4 | 6 464,4 | 6 120,7 | 5 721,6 | 5 721,6 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 09 de Agosto de 2016 | | | | | 81,0 |
| Vencimiento de SC - Venta del 08 al 12 de agosto de 2016 | | | | | 0,0 |
| 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 |
| 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 |
| ii. Compras de BTP | | | | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 4 255,7 | 4 561,5 | 4 802,9 | 4 605,7 | 4 103,3 |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). | | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0135% | 0,0135% | 0,0135% | 0,0135% | 0,0135% |
| 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. Débitos Overnight en moneda nacional | 166,3 | 225,4 | 212,0 | 1 062,7 | 941,1 |
| 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 | 4 089,4 | 4 336,1 | 4 590,9 | 3 543,0 | 3 162,2 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 9 254,5 | 8 465,1 | 9 418,4 | 9 203,4 | 9 203,4 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 39,5 | 12,4 | 8,5 | 8,3 | 8,3 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 2 243,4 | 4 089,4 | 4 212,8 | 4 338,8 | 4 045,3 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 17,4 | 4,8 | 3,9 | 3,7 | 3,7 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 1 712,0 | 1 810,5 | 1 798,5 | 1 032,0 | 1 181,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,25/4,30/4,26 | 4,25/4,30/4,25 | 4,25/4,25/4,25 | 4,25/4,25/4,25 | 4,25/4,30/4,25 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | sim | 29,0 | 38,0 | 46,0 | 49,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | 0,55 / 0,55 / 0,55 | 0,55 / 0,55 / 0,55 | 0,55 / 0,55 / 0,55 | 0,55 / 0,55 / 0,55 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV | 46,5 | 37,0 | 40,5 | 20,0 | 205,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | | | 100,0 / 4,30 |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| Plazo 18 meses (monto / tasa promedio) | | 30,0 / 4,90 | | 20,0 / 4,90 | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 27 julio 16 | 01 agosto 16 | 02 agosto 16 | 03 agosto 16 | 04 agosto 16 |
| Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g | -9,9 | 5,8 | 21,3 | -22,6 | -65,0 |
| Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g | 83,7 | 39,6 | 63,7 | 13,8 | 91,5 |
| a. Mercado spot con el público | 119,6 | 8,3 | 60,4 | 82,7 | 82,7 |
| i. Compras | 322,5 | 207,6 | 190,2 | 241,1 | 263,9 |
| ii. (-) Ventas | 202,9 | 199,3 | 139,7 | 147,7 | 181,2 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | 6,7 | 61,1 | 60,2 | 54,8 | -33,0 |
| i. Facturas | 92,1 | 154,3 | 178,3 | 210,8 | 174,1 |
| ii. (-) Vencidas | 85,4 | 93,2 | 116,1 | 156,0 | 207,1 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 53,9 | 58,9 | 71,8 | -15,1 | 10,2 |
| i. Facturas | 195,3 | 124,0 | 99,0 | 75,1 | 87,7 |
| ii. (-) Vencidas | 141,4 | 65,2 | 27,2 | 90,1 | 77,5 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 324,5 | 216,5 | 300,2 | 215,2 | 176,5 |
| ii. A futuro | 0,0 | 3,0 | 9,0 | 55,0 | 0,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 56,6 | 2,8 | -61,6 | -62,2 | -136,2 |
| i. Compras | 133,1 | 40,5 | 24,8 | 89,6 | 68,2 |
| ii. (-) Ventas | 76,5 | 37,7 | 110,9 | 151,8 | 204,4 |
| f. Efecto de Opciones | -0,6 | -3,1 | -0,1 | -5,8 | 4,5 |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -82,2 | -38,7 | -29,8 | -189,7 | -102,3 |
| h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,3531 | 3,3431 | 3,3457 | 3,3549 | 3,3365 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |