

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	15 Agosto 16			16 Agosto 16			17 Agosto 16			18 Agosto 16			19 Agosto 16	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	5 976,4			5 421,3			3 686,2			3 731,4			2 495,2	
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)	50,0	200,0	200,0	200,0	200,0	50,0	100,0	100,0	50,0	200,0	200,0	150,0	100,0	
Propuestas recibidas	191,0	527,0	616,0	448,8	594,0	289,0	444,0	360,7	297,0	390,4	502,0	180,0	380,0	
Plazo de vencimiento	185 d	120 d	360 d	119 d	359 d	540 d	540 d	358 d	364 d	364 d	539 d	89 d	543 d	
Tasas de interés Mínima	4,59	4,45	4,80	4,45	4,80	4,97	4,97	4,79	4,75	4,75	4,92	4,00	4,95	
Máxima	4,59	4,49	4,84	4,50	4,83	4,97	5,00	4,80	4,75	4,90	4,99	4,15	4,98	
Promedio	4,59	4,46	4,83	4,49	4,82	4,97	4,98	4,80	4,75	4,81	4,95	4,05	4,96	
Saldo	23 142,2			23 542,2			23 792,2			24 242,2			24 492,2	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 08 de setiembre de 2016				589,0									589,0	
Vencimiento de CD BCRP del 22 al 26 de agosto de 2016				0,0									0,0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)														
Propuestas recibidas														
Plazo de vencimiento														
Tasas de interés Mínima														
Máxima														
Promedio														
Saldo	800,0			800,0			800,0			800,0			800,0	
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 30 de Setiembre de 2016				200,0									200,0	
Vencimiento de REPO BCRP del 22 al 26 de agosto de 2016				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	
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 22 al 26 de agosto de 2016				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	
Vencimientos de CDV BCRP del 22 al 26 de agosto de 2016				0,0									0,0	
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	500,0	1000,0	1191,8	500,0	999,9	1200,0	885,4	700,0	500,0	1200,1	1200,1	500,1	500,1	
Propuestas recibidas	970,0	1584,0	1941,3	959,2	1983,7	2064,1	885,4	821,6	855,3	2081,3	2081,3	676,9	676,9	
Plazo de vencimiento	7 d	1 d	1 d	7 d	1 d	1 d	1 d	1 d	7 d	1 d	1 d	7 d	7 d	
Tasas de interés Mínima	4,10	3,88	3,90	4,00	3,95	3,95	4,00	3,95	4,02	3,98	4,00	4,08	4,08	
Máxima	4,20	4,15	4,15	4,18	4,14	4,10	4,25	4,25	4,21	4,19	4,20	4,20	4,20	
Promedio	4,13	4,09	4,08	4,14	4,11	4,05	4,14	4,12	4,20	4,12	4,12	4,19	4,19	
Saldo	3 691,8			2 199,9			3 585,4			3 200,1			2 000,1	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 22 agosto 2016				2 199,9									2 000,1	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 22 al 26 de agosto de 2016				3 199,9									2 000,1	
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 2 Setiembre de 2016				300,0									300,0	
Vencimiento de Coloc-TP del 22 al 26 de agosto de 2016				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	
Vencimiento de Coloc - BN del 22 al 26 de agosto de 2016				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	1 408,0			1 108,0			1 108,0			1 048,0			1 048,0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 23 de agosto de 2016				60,0									200,0	
Vencimiento de CDR BCRP del 22 al 26 de agosto de 2016				60,0									200,0	
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)														
Propuestas recibidas														
Plazo de vencimiento														
Tasas de interés Mínima														
Máxima														
Promedio														
Saldo	15 700,1			15 700,1			15 700,1			15 700,1			15 200,1	
Próximo vencimiento de Repo Regular el 03 de Octubre de 2016				500,0									300,0	
Vencimiento de REPO del 22 al 26 de agosto de 2016				500,0									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	
Vencimiento de REPO Expansión del 22 al 26 de agosto de 2016				0,0									0,0	
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	
Vencimiento de REPO Sustitución del 22 al 26 de agosto de 2016				0,0									0,0	
xii. Subasta de Swap Cambiaria Venta del BCRP														
Propuestas recibidas														
Plazo de vencimiento														
Tasas de interés Mínima														
Máxima														
Promedio														
Saldo	3 569,9			3 391,6			3 120,2			2 954,2			2 792,2	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 22 de Agosto de 2016													5,0	
Vencimiento de SC - Venta del 22 al 26 de agosto de 2016													364,1	
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\$)	0,0			0,0			0,0			0,0			0,0	
Tipo de cambio promedio														
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)														
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0			0,0			0,0			0,0			0,0	
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0			0,0			0,0			0,0			0,0	
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														
Saldo	2 834,6			2 321,4			1 850,8			1 581,3			1 745,1	
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones														
4. Operaciones monetarias del BCR por el cierre de operaciones														
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).														
i. Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0136%			0,0137%			0,0136%			0,0137%			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	158,0			354,1			153,0			11,5			438,6	
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														
e Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	8 650,7			8 670,0			8 358,3			8 356,3			8 233,9	
f Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,8			7,8			7,5			7,5			7,4	
g Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 507,2			3 327,0			3 242,0			3 151,1			3 054,1	
h Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,0			3,1			2,8			2,8			2,7	
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP														
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	338,0			234,0			219,0			646,5			906,8	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,90/3,90/3,90			3,90/4,00/3,98			4,10/4,15/4,11			4,10/4,25/4,20			4,05/4,15/4,10	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	147,0			119,0			119,0			119,0			119,0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,40/0,40/0,40			0,40/0,40/0,40			0,40			0,40/0,40/0,40			0,40	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0			260,0			94,0			162,8			200,0	
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	54,4			50,0 / 4,30			50,0 / 4,30			30,0 / 4,30			30,0 / 4,30	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	54,4			50,0 / 4,80			50,0 / 4,80			57,7 / 4,80			100,0 / 4,78	
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)	54,4			50,0 / 4,80			50,0 / 4,80			57,7 / 4,80			100,0 / 4,78	
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)														
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	34,1			-3,2			-129,8			28,9			-86,7	
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	121,1			17,7			-74,5			-28,7			-73,9	
a. Mercado spot con el público	166,8			35,7			18,0			4,8			0,0	
i. Compras	339,0			228,2			228,2			197,1			177,0	
ii. (c) Ventas	172,2			297,8			177,2			177,2			177,0	
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-108,9			123,7			-0,1			100,4			-81,3	
i. Placadas	35,2			230,8			341,7			417,2			115,9	
ii. (c) Ventas	144,1			107,1			341,8			316,8			207,2	
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-123,6			73,1			21,4			-18,6			-52,6	
i. Placadas	54,4			113,0			113,0			113,5			104,8	
ii. (c) Ventas	178,0			39,9			130,1			134,1			157,3	
d. Operaciones cambiarias interbancarias														
i. Al contado	438,6			416,7			225,3			384,4			333,0	
ii. A futuro	24,0			45,0			45,0			24,0			16,0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega														
i. Compras	-10,5			-86,1			-214,8			-63,1			-39,7	
ii. (c) Ventas	129,7			123,3			123,3			145,1			145,1	
f. Efecto de Operaciones	139,2			98,4			338,6			277,9			184,8	
g. Efecto de Operaciones	54,4			2,8			19,4			21,0			-0,1	
h. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-103,2			-74,5			-142,5			-84,6			-88,1	
i. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera														
Tasa de interés														
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,3162			3,3102			3,3085			3,3163			3,3049	
(*) Datos preliminares														