

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	17 Octubre 16	18 Octubre 16	19 Octubre 16	20 Octubre 16	21 Octubre 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3,459.0	3,053.9	1,859.5	1,953.8	727.1
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)	30.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Propuestas recibidas	223.7	697.5	833.0	806.0	200.0
Plazo de vencimiento	171 d	360 d	542 d	175 d	541 d
Tasas de Inter Mínima	4.35	4.47	4.59	4.35	4.55
Máxima	4.39	4.52	4.60	4.35	4.59
Promedio	4.38	4.50	4.60	4.35	4.58
Saldo	26,815.0	27,215.0	27,345.0	27,345.0	27,375.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de noviembre de 2016	125.0	125.0	125.0	125.0	125.0
Vencimiento de CD BCRP del 24 al 28 de octubre de 2016	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	600.0	600.0	600.0	600.0	1,100.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 5 de Diciembre de 2016	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Repo BCRP del 24 al 28 de octubre de 2016	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 24 al 28 de octubre 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
Vencimientos de CDV BCRP del 24 al 28 de octubre de 2016	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	600.0	600.0	600.0	600.0	600.0
Plazo de vencimiento	1,266.7	1,267.2	1,267.2	1,267.2	1,267.2
Tasas de Inter Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Máxima	3.95	3.87	3.87	3.87	3.87
Promedio	4.16	4.05	4.05	4.05	4.05
Saldo	4.07	4.00	4.00	4.00	4.00
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	982.6	982.6	982.6	982.6	982.6
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 24 al 28 de octubre de 2016	600.0	600.0	600.0	600.0	600.0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas	982.6	982.6	982.6	982.6	982.6
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,300.0	1,300.0	1,300.0	1,300.0	1,300.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 15 Diciembre de 2016	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 24 al 28 de octubre de 2016	0.0	0.0	0.0	0.0	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 del 24 al 28 de octubre 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	1,300.0	1,300.0	1,300.0	1,300.0	1,300.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 28 de octubre de 2016	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de CDR BCRP del 24 al 28 de octubre de 2016	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	14,920.1	14,920.1	14,920.1	14,920.1	14,920.1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 4 de Noviembre de 2016	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Repo del 24 al 28 de octubre 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 del 24 al 28 de octubre de 2016	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
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	243.0	243.0	243.0	243.0	243.0
Vencimiento de Repo Sustitución del 24 al 28 de octubre de 2016	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xii. Subasta de Swap Cambiaria Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	620.0	500.0	500.0	500.0	500.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el	500.0	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de SC - Venta del 24 al 28 de octubre de 2016	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
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 y BTP					
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	2,429.0	2,053.9	1,729.5	1,923.8	1,344.1
4. Operaciones monetarias del BCR por el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0133%	0.0133%	0.0134%	0.0133%	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					
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
Depósitos Overnight en moneda nacional	165.5	56.2	14.4	370.9	172.9
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	2,263.5	1,997.7	1,715.9	1,552.9	1,174.2
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	8,294.9	8,328.1	8,155.9	8,092.6	7,952.5
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.4	7.4	7.2	7.2	7.1
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,062.0	3,011.5	2,943.2	2,899.9	2,808.0
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.7	2.7	2.6	2.6	2.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1,434.0	882.0	889.0	1,036.5	782.0
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	4.25/4.35/4.30
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	18.0	18.0	18.0	23.0	18.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0.50 / 0.50 / 0.50	0.50 / 0.50 / 0.50	0.50 / 0.50 / 0.50	0.50 / 0.50 / 0.50	0.50 / 0.50 / 0.50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	80.0	30.0	0.0	100.0	77.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	30.0 / 4.39				
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	14 octubre 16	17 octubre 16	18 octubre 16	19 octubre 16	20 octubre 16
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	68.2	47.9	25.2	36.4	122.5
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	68.2	47.9	25.2	36.4	122.5
a. Mercado spot con el público					
i. Compras	215.1	-3.9	-71.0	-118.1	57.2
ii. Ventas	158.4	200.2	167.5	161.5	301.6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)					
i. Pactadas	103.9	136.9	238.8	258.4	166.4
ii. Vencidas	45.3	84.7	195.1	94.8	280.9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)					
i. Pactadas	35.7	-32.8	90.7	9.3	-191.2
ii. Vencidas	103.4	79.4	127.8	93.5	98.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	372.4	275.5	315.9	395.1	374.0
ii. A futuro	0.0	0.0	0.0	11.0	20.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega					
i. Compras	21.8	-3.9	-158.9	-14.3	10.7
ii. Ventas	62.2	74.8	29.8	75.8	287.2
f. Efecto de Opciones	40.4	78.7	188.3	89.8	276.5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0.2	-0.2	-0.2	-0.4	-0.1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	-0.3	-1.7	-4.4	-2.6	-13.6
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3.4016	3.3990	3.3861	3.3809	3.3835
(*) Datos preliminares					