

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	24 Octubre 16	25 Octubre 16	26 Octubre 16	27 Octubre 16	28 Octubre 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 045,1	1 252,6	1 969,7	1 846,3	970,9
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)					
Propuestas recibidas	30,0		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	140,5		157,0	156,0	
Tasas de Inter Mínima	169 d		53,0	35,0	
Máxima	4,35		4,59	4,53	
Promedio	4,42		4,65	4,55	
Saldo	4,39		4,63	4,54	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de noviembre de 2016	27 405,0	27 405,0	27 435,0	27 465,0	27 465,0
Vencimiento de CD BCRP del 31 de octubre al 4 de Noviembre de 2016	125,0		125,0	125,0	125,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	700,0				
Plazo de vencimiento	1 010,0				
Tasas de Inter Mínima	1 d				
Máxima	4,40				
Promedio	4,55				
Saldo	4,47				
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 5 de diciembre de 2016	1 300,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de Repo BCRP del 31 de octubre al 4 de Noviembre de 2016	700,0				300,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas	0,0		0,0		
Plazo de vencimiento	0,0		0,0		
Tasas de Inter Mínima	0,0		0,0		
Máxima	0,0		0,0		
Promedio	0,0		0,0		
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 31 de octubre al 4 de Noviembre de 2016	0,0		0,0		0,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas	0,0				
Plazo de vencimiento	0,0				
Tasas de Inter Mínima	0,0				
Máxima	0,0				
Promedio	0,0				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el	0,0		0,0		0,0
Vencimientos de CDV BCRP del 31 de octubre al 4 de Noviembre de 2016	0,0		0,0		0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	300,0			500,0	
Plazo de vencimiento	1 413,8			932,0	
Tasas de Inter Mínima	1 d			1 d	
Máxima	3,75			3,48	
Promedio	3,87			3,85	
Saldo	3,79			3,75	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el	300,0		300,0	300,0	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 31 de octubre al 4 de Noviembre de 2016	300,0		300,0	500,0	
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas	0,0				
Plazo de vencimiento	0,0				
Tasas de Inter Mínima	0,0				
Máxima	0,0				
Promedio	0,0				
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
Vencimiento de Coloc-TP del 31 de octubre al 4 de Noviembre de 2016	0,0		0,0		0,0
vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas	0,0				
Plazo de vencimiento	0,0				
Tasas de Inter Mínima	0,0				
Máxima	0,0				
Promedio	0,0				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de Coloc - BN del 31 de octubre al 4 de Noviembre de 2016	0,0		0,0		0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	0,0				
Plazo de vencimiento	0,0				
Tasas de Inter Mínima	0,0				
Máxima	0,0				
Promedio	0,0				
Saldo	1 300,0	1 300,0	1 300,0	1 300,0	1 200,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 31 de octubre de 2016	100,0		100,0		100,0
Vencimiento de CDR BCRP del 31 de octubre al 4 de Noviembre de 2016	100,0		100,0		200,0
ix. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas	0,0				
Plazo de vencimiento	0,0				
Tasas de Inter Mínima	0,0				
Máxima	0,0				
Promedio	0,0				
Saldo	14 737,1	14 737,1	14 737,1	14 737,1	14 737,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 4 de Noviembre de 2016	500,0		500,0		500,0
Vencimiento de Repo del 31 de octubre al 4 de Noviembre de 2016	0,0		0,0		500,0
x. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas	0,0				
Plazo de vencimiento	0,0				
Tasas de Inter Mínima	0,0				
Máxima	0,0				
Promedio	0,0				
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
Vencimiento de REPO Expansión del 31 de octubre al 4 de Noviembre de 2016	0,0		0,0		0,0
xi. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas	0,0				
Plazo de vencimiento	0,0				
Tasas de Inter Mínima	0,0				
Máxima	0,0				
Promedio	0,0				
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
Vencimiento de REPO Sustitución del 31 de octubre al 4 de Noviembre de 2016	0,0		0,0		0,0
xii. Subasta de Swap Cambiaria Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	0,0				
Plazo de vencimiento	0,0				
Tasas de Inter Mínima	0,0				
Máxima	0,0				
Promedio	0,0				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el	0,0		0,0		0,0
Vencimiento de SC - Venta del 31 de octubre al 4 de Noviembre de 2016	0,0		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neoposición del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio	0,0		0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio	0,0		0,0	0,0	0,0
iii. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
L. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0		0,0	0,0	0,0
M. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0		0,0	0,0	0,0
c. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
L. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0		0,0	0,0	0,0
M. Compras de BTP	0,0		0,0	0,0	0,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 715,1	1 252,6	1 639,7	1 316,3	970,9
4. Operaciones monetarias del BCR por el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	0,0134%	0,0134%	0,0134%	0,0134%	0,0134%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	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%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	245,1	198,8	485,2	266,2	646,9
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	1 470,0	1 053,8	1 154,5	1 050,1	614,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	7 760,3	7 624,1	7 576,3	7 524,5	7 499,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,9	6,9	6,9	6,7	6,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 615,9	2 499,9	2 448,2	2 396,4	2 332,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,3	2,2	2,2	2,1	2,1
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 509,5	1 378,0	750,0	889,0	1 079,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,30/4,26	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\$)	0,0	0,0	365,0	348,0	252,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,0	0,0	0,50/0,55/0,50	0,50/0,55/0,50	0,50/0,55/0,51
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	30,0	170,0	237,5	46,0	41,1
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	30,0 / 4,36				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	21 octubre 16	24 octubre 16	25 octubre 16	26 octubre 16	27 octubre 16
Flujo de la posición global = a + b i - c i + e + f + g	-153,5	-60,5	32,0	57,5	133,9
Flujo de la posición contable = a + b i i - c i i + e + f + g	-94,7	-13,8	-130,8	85,6	80,8
a. Mercado spot con el público	-65,4	35,0	-21,9	85,1	41,1
i. Compras	212,6	256,3	207,4	266,3	288,8
ii. Ventas	278,1	220,3	220,3	151,2	227,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	102,5	-8,2	-33,7	-64,1	-216,2
i. Placadas	131,8	318,1	210,2	134,4	245,0
ii. Vencidas	29,3	326,3	175,5	188,6	461,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	20,4	37,7	-129,0	-28,5	-284,9
i. Placadas	160,9	246,0	32,9	32,9	97,4
ii. Vencidas	140,5	208,4	167,8	59,4	362,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	389,6	416,7	432,5	444,2	351,3
ii. A futuro	0,0	13,0	10,0	23,0	10,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	99,2	-144,5	-127,3	-73,9	-73,9
i. Compras	118,4	142,9	177,1	186,0	361,3
ii. Ventas	25,2	321,6	174,0	186,0	435,2
f. Efecto de Opciones	-0,4	-0,9	-0,9	4,4	4,4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-151,8	-22,2	-86,3	-1,4	14,8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,3648	3,3514	3,3587	3,3653	3,3729
(*) Datos preliminares					