

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**  
(Millones de Soles)

	07 Noviembre 16	08 Noviembre 16	09 Noviembre 16	10 Noviembre 16	11 Noviembre 16
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>1 248,2</b>	<b>1 660,1</b>	<b>2 095,3</b>	<b>3 504,0</b>	<b>3 397,4</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CD BCRP)	30,0		30,0	30,0	
Propuestas recibidas	144,0		194,0	157,9	
Plazo de vencimiento	185 d		547 d	364 d	
Tasas de Inter Mínima	4,35		4,53	4,45	
Máxima	4,36		4,68	4,52	
Promedio	4,36		4,66	4,50	
Saldo	27 460,0	27 460,0	27 490,0	26 074,2	26 074,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de noviembre de 2016	1 445,8		1 445,8		150,0
Vencimiento de CD BCRP del 14 al 16 de Noviembre de 2016	1 445,8		1 445,8		150,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	200,0	2400,0	1000,0	199,0	1000,0
Propuestas recibidas	505,0	3105,8	2805,8	531,0	2253,8
Plazo de vencimiento	182 d	1 d	1 d	181 d	1 d
Tasas de Inter Mínima	5,58	4,41	4,86	4,80	4,43
Máxima	5,58	4,89	5,00	4,80	4,80
Promedio	5,58	4,82	4,86	4,94	4,47
Saldo	3 200,0	2 999,0	2 599,0	999,0	999,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 05 de diciembre de 2016	2 400,0		1 600,0		300,0
Vencimiento de REPO BCRP del 14 al 16 de Noviembre de 2016	2 400,0		1 600,0		300,0
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 14 al 16 de Noviembre 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 14 al 16 de Noviembre de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	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					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 14 al 16 de Noviembre de 2016					
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
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 Coloc-TP el 15 Diciembre de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 14 al 16 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					
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					
Vencimiento de Coloc - BN del 14 al 16 de Noviembre de 2016					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas				255,0	150,0
Plazo de vencimiento				61 d	61 d
Tasas de Inter Mínima				-0,25	0,00
Máxima				0,45	0,20
Promedio				-0,04	0,07
Saldo	1 000,0	1 000,0	1 000,0	1 255,0	1 705,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 14 de noviembre de 2016	200,0		200,0		200,0
Vencimiento de CDR BCRP del 14 al 16 de Noviembre de 2016	0,0		0,0		300,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	14 237,1	14 237,1	14 237,1	14 237,1	14 237,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 16 de Junio de 2017	400,0		400,0		400,0
Vencimiento de Repo del 14 al 16 de Noviembre de 2016	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
Vencimiento de REPO Expansión del 14 al 16 de Noviembre de 2016					
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
Vencimiento de REPO Sustitución del 14 al 16 de Noviembre de 2016	0,0		0,0		0,0
xii. Subasta de Swap Cambiaria Venta del BCRP					
Propuestas recibidas				299,9	20,0
Plazo de vencimiento				61 d	61 d
Tasas de Inter Mínima				0,15	0,14
Máxima				0,40	0,14
Promedio				0,29	0,14
Saldo				319,9	0,14
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de enero 2017					769,9
Vencimiento de SC - Venta del 14 al 16 de Noviembre de 2016					319,9
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación 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 y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>3 812,2</b>	<b>3 859,1</b>	<b>3 665,3</b>	<b>3 219,0</b>	<b>2 947,4</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR por el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0134%	0,0134%	0,0134%	0,0133%	0,0132%
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. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>3 760,6</b>	<b>3 781,6</b>	<b>3 571,7</b>	<b>2 850,4</b>	<b>2 588,8</b>
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	8 298,8	8 178,8	8 470,7	8 001,3	8 429,7
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,4	7,4	7,6	7,2	7,6
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 152,2	3 287,3	3 318,9	3 373,8	3 302,5
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,8	2,8	3,0	2,6	3,0
<b>6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	896,5	804,5	1 310,0	2 293,0	2 064,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,40/4,35	4,35/4,35/4,35	4,25/4,25/4,25	4,25/4,30/4,26	4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	20,0	30,0	67,0	1,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>04 noviembre 16</b>	<b>07 noviembre 16</b>	<b>08 noviembre 16</b>	<b>09 noviembre 16</b>	<b>10 noviembre 16</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-20,2	-7,1	-0,7	59,7	-2,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f + g	13,7	42,7	42,7	29,9	233,5
a. Mercado spot con el público	18,1	43,7	-12,1	30,1	170,0
i. Compras	289,7	248,1	167,0	251,6	362,2
ii (c) Ventas	250,6	204,4	179,2	221,4	192,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-19,1	-3,1	3,7	-307,1	40,4
i. Pactadas	67,8	289,2	204,9	46,9	54,1
ii (c) Vencidas	48,7	292,3	201,2	354,0	13,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	52,6	46,2	34,0	-329,9	389,9
i. Pactadas	99,8	74,5	103,2	73,6	403,9
ii (c) Vencidas	47,2	57,0	40,5	403,5	34,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	244,9	235,1	259,7	464,2	259,0
ii. A futuro	10,0	27,0	20,0	8,0	8,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-6,0	-133,4	-133,4	53,8	5,2
i. Compras	41,0	53,5	53,5	493,3	16,5
ii (c) Ventas	47,0	276,0	169,2	349,5	11,3
f. Efecto de Opciones	-0,4	-0,6	15,2	-0,3	-0,3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,2	-11,9	-0,8	-5,6	172,5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,3837	3,3725	3,3609	3,3762	3,4073
(*) Datos preliminares					