

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU				
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS (Millones de Soles)				
	05 Diciembre 16	06 Diciembre 16	07 Diciembre 16	09 Diciembre 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2,323.9	3,345.4	3,295.4	1,894.1
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)				
Propuestas recibidas	30.0		30.0	
Plazo de vencimiento	111.5		161.0	
Tasas de Inter	185.4		547.4	
Minima	4.15		4.44	
Maxima	4.30		4.50	
Promedio	4.29		4.50	
Saldo	25,219.3	25,219.3	25,249.3	25,249.3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de diciembre de 2016		1,299.9		1,299.9
Vencimiento de CD BCRP Del 12 al 16 de diciembre de 2016		0.0		0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1000.0	300.0	900.0	1,000.0
Propuestas recibidas	3393.0	618.0	1912.8	2,547.0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de Inter	4.85	5.31	4.26	4.46
Minima	5.01	5.31	4.65	4.97
Maxima	4.92	5.31	4.30	4.72
Promedio	4.099.0		3,199.0	2,799.0
Saldo			1,000.0	1,109.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 12 de diciembre de 2016			2,200.0	2,109.0
Vencimiento de REPO BCRP Del 12 al 16 de diciembre de 2016				
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter				
Minima				
Maxima				
Promedio				
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR				
Vencimiento de Repo Especial - CDR Del 12 al 16 de diciembre de 2016				
iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter				
Minima				
Maxima				
Promedio				
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el				
Vencimientos de CDV BCRP Del 12 al 16 de diciembre de 2016				
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter				
Minima				
Maxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el				
Vencimiento de Depósitos a Plazo Del 12 al 16 de diciembre de 2016				
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter				
Minima				
Maxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 15 Diciembre de 2016	1,300.0	1,300.0	1,300.0	1,300.0
Vencimiento de Coloc-TP Del 12 al 16 de diciembre de 2016		300.0		300.0
vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter				
Minima				
Maxima				
Promedio				
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el				
Vencimiento de Coloc - BN Del 12 al 16 de diciembre de 2016				
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reaustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter				
Minima				
Maxima				
Promedio				
Saldo	1,305.0	1,305.0	805.0	805.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 10 de enero de 2017		500.0		255.0
Vencimiento de CDR BCRP Del 12 al 16 de diciembre de 2016		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter				
Minima				
Maxima				
Promedio				
Saldo	14,237.1	14,237.1	14,237.1	14,237.1
Próximo vencimiento de Reco Regular el 16 de Junio de 2017		400.0		400.0
Vencimiento de REPO Del 12 al 16 de diciembre de 2016		0.0		0.0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter				
Minima				
Maxima				
Promedio				
Saldo	7,900.0	7,900.0	7,900.0	7,900.0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 17 de Enero de 2017		300.0		300.0
Vencimiento de REPO Expansion Del 12 al 16 de diciembre de 2016				
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Inter				
Minima				
Maxima				
Promedio				
Saldo	4,804.7	4,804.7	4,804.7	4,804.7
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 28 de Mayo de 2017		243.0		243.0
Vencimiento de REPO Sustitucion Del 12 al 16 de diciembre de 2016		0.0		0.0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				
Propuestas recibidas	200.0			
Plazo de vencimiento	412.0			
Tasas de Inter	63.4			
Minima	-0.10			
Maxima	0.00			
Promedio	-0.05			
Saldo	1,120.9	1,120.9	1,120.9	1,120.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de enero 2017		319.9		319.9
Vencimiento de SC - Venta Del 12 al 16 de diciembre de 2016		0.0		0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	0.0	0.0
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	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	4,493.9	4,345.4	3,865.4	3,003.1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0132%	0.0132%	0.0125%	0.0125%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de Interés	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%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	97.1	83.3	78.4	56.0
Tasa de Interés	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	4,396.8	4,262.1	3,787.0	2,947.1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)*	9,387.6	9,302.4	9,296.6	9,245.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8.2	8.2	8.1	8.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4,036.3	4,073.9	4,144.7	3,971.9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.6	3.6	3.6	3.5
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	368.0	531.0	595.0	832.0
Tasas de Interés: Minima / Maxima / Promedio				
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	4,504,604.59	4,254,254.25	4,254,254.25	4,254,254.25
Tasas de Interés: Minima / Maxima / Promedio	4.5	0.0	0.0	25.0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.50/0.50/0.50	289.0	282.5	0.50/0.50/0.50
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	20.0			83.6
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		200.0 / 4.34		
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	02 diciembre 16	05 diciembre 16	06 diciembre 16	07 diciembre 16
Flujo de la posición global = a + b - c - d + e + f + g	-30.3	119.8	2.7	-14.3
Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + f + g	-5.5	68.0	6.7	-63.9
a. Mercado spot con el público	-7.9	47.2	10.3	78.2
i. Compras	282.1	250.3	220.2	314.4
ii (-) Ventas	290.0	293.0	210.0	286.3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	32.6	-36.5	-26.4	157.3
i. Pastadas	55.4	271.0	226.1	279.1
ii (-) Ventadas	22.8	307.6	252.6	121.8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	59.2	-29.8	-25.4	98.2
i. Pastadas	114.8	102.3	102.3	215.6
ii (-) Ventadas	55.6	124.2	127.7	117.5
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	292.1	317.9	323.2	374.5
ii. A futuro	0.0	3.0	0.0	0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	34.7	-124.8	2.1	2.1
f. Compras	54.7	123.3	127.3	114.2
g. Ventas	20.0	228.1	252.1	112.1
h. Efecto de Opciones	1.8	0.1	-0.9	-0.9
i. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0.5	0.6	-1.7	-148.1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de Interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datafec)	3.4136	3.4213	3.4162	3.4067
(*) Datos preliminares				