

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	12 Diciembre 16	13 Diciembre 16	14 Diciembre 16	15 Diciembre 16	16 Diciembre 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2,312.4	4,023.6	3,847.4	4,197.2	3,130.0
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	200.0	200.0	30.0	30.0
Plazo de vencimiento	148.2	515.0	569.0	87.0	109.6
Tasas de Inter	179.0	177.0	369.0	357.0	357.0
Mínima	4.15	4.19	4.27	4.25	4.35
Máxima	4.26	4.30	4.44	4.68	4.36
Promedio	4.21	4.25	4.37	4.54	4.35
Saldo	26,279.3	24,379.4	24,409.4	22,944.4	22,944.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de diciembre de 2016	1,299.9		1,455.0		100.0
Vencimiento de CD BCRP el 19 al 23 de diciembre de 2016	2,799.4		1,455.0		0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	200.0				
Plazo de vencimiento	1 d				
Tasas de Inter	4.26				
Mínima	4.40				
Máxima	4.26				
Promedio	4.26				
Saldo	1,199.0	999.0	999.0	999.0	999.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 20 de diciembre de 2016	200.0		300.0		300.0
Vencimiento de REPO BCRP del 19 al 23 de diciembre de 2016	200.0		300.0		300.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Plazo de vencimiento	0.0				
Tasas de Inter	0.0				
Mínima	0.0				
Máxima	0.0				
Promedio	0.0				
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR	0.0				
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 19 al 23 de diciembre de 2016	0.0				
iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Plazo de vencimiento	0.0				
Tasas de Inter	0.0				
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				
Vencimientos de CDV BCRP del 19 al 23 de diciembre de 2016	0.0				
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	800.0	800.0	500.0	200.0	1,900.0
Plazo de vencimiento	1,972.1	1,972.1	1,972.1	2,000.0	2,606.6
Tasas de Inter	3.60	3.60	3.94	3.88	3.70
Mínima	4.00	4.00	4.25	4.25	4.04
Máxima	3.92	3.92	4.16	4.22	3.93
Promedio	3.92	3.92	4.16	4.22	3.93
Saldo	800.0	800.0	1,671.3	2,600.0	1,900.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 19 de diciembre de 2016	0.0		1,171.3		1,200.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 19 al 23 de diciembre de 2016	0.0		1,171.3		1,700.0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Plazo de vencimiento	0.0				
Tasas de Inter	0.0				
Mínima	0.0				
Máxima	0.0				
Promedio	0.0				
Saldo	1,300.0	1,300.0	1,300.0	1,000.0	800.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el de 2017	300.0		300.0		
Vencimiento de Coloc-TP del 19 al 23 de diciembre 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	0.0	0.0	0.0	0.0
Plazo de vencimiento	0.0				
Tasas de Inter	0.0				
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				
Vencimiento de Coloc - BN del 19 al 23 de diciembre de 2016	0.0				
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	805.0	805.0	805.0	805.0	805.0
Plazo de vencimiento	255.0	255.0	255.0	255.0	255.0
Tasas de Inter	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Mínima	0.0				
Máxima	0.0				
Promedio	0.0				
Saldo	805.0	805.0	805.0	805.0	805.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 10 de enero de 2017	255.0		255.0		255.0
Vencimiento de CDR BCRP del 19 al 23 de diciembre de 2016	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Plazo de vencimiento	0.0				
Tasas de Inter	0.0				
Mínima	0.0				
Máxima	0.0				
Promedio	0.0				
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 19 al 23 de diciembre de 2016	0.0		0.0		0.0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas	7,900.0	7,900.0	7,900.0	7,900.0	7,900.0
Plazo de vencimiento	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Tasas de Inter	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 19 al 23 de diciembre de 2016	0.0		0.0		0.0
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas	4,804.7	4,804.7	4,804.7	4,804.7	4,804.7
Plazo de vencimiento	243.0	243.0	243.0	243.0	243.0
Tasas de Inter	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 19 al 23 de diciembre de 2016	0.0		0.0		0.0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	1,120.9	1,120.9	1,120.9	1,120.9	1,120.9
Plazo de vencimiento	319.9	319.9	319.9	319.9	319.9
Tasas de Inter	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Mínima	0.0				
Máxima	0.0				
Promedio	0.0				
Saldo	1,120.9	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		319.9
Vencimiento de SC - Venta del 19 al 23 de diciembre de 2016	0.0		0.0		0.0
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	0.0				
ii. Ventas (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0				
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
Compras de BTP	0.0				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2,462.4	2,823.6	2,146.1	2,067.2	1,930.0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0133%	0.0133%	0.0133%	0.0133%	0.0133%
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	70.5	826.8	192.6	365.0	140.7
Tipo de cambio promedio	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	2,411.9	1,996.8	1,953.5	1,702.2	1,789.3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	9,018.0	9,078.0	8,808.6	8,738.2	8,607.9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.9	7.9	7.7	7.6	7.5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,762.4	3,641.3	3,520.7	3,403.3	3,302.4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.3	3.3	3.1	3.0	2.9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	803.0	985.0	874.0	859.0	1,355.0
Tasas de Inter: 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	4.25/4.25/4.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	70.0	70.0	70.0	70.0	14.5
Tasas de Inter: 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	0.70/0.75/0.73
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	200.0	495.0	970.2	877.2	361.2
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			30.0 / 4.37	86.0 / 4.37	18.7 / 4.37
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	09 diciembre 16	12 diciembre 16	13 diciembre 16	14 diciembre 16	15 diciembre 16
Flujo de la posición global = a + b - c - d + e + f + g	-4.9	8.4	-27.5	-7.6	111.9
Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + f + g	-6.4	-36.9	-37.2	-22.0	133.3
a. Mercado spot con el público	-28.8	-24.8	-41.0	-25.7	152.9
i. Compras	234.5	216.4	277.6	311.9	445.0
ii. Ventas	263.3	241.1	318.6	337.7	292.1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	63.9	60.0	-287.0	86.2	-2.0
i. Facturas	97.5	116.7	55.0	115.5	64.4
ii. Ventas	33.6	56.7	344.9	30.4	66.3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	62.9	-15.3	-296.9	71.6	19.4
i. Facturas	158.3	107.9	112.1	119.2	119.3
ii. Ventas	95.4	123.3	409.0	68.8	100.3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	443.0	232.0	317.8	314.9	328.0
ii. A futuro	10.0	0.0	30.0	0.0	13.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	81.7	26.0	82.1	44.4	20.3
i. Compras	93.5	107.7	95.1	68.4	77.1
ii. Ventas	11.8	81.7	313.0	24.0	56.8
f. Efecto de Opciones	0.4	0.0	-0.2	0.1	0.1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	2.5	-3.6	-14.3	-2.5	-6.0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.4006	3.4028	3.3977	3.3954	3.4053
(*) Datos preliminares					