

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

| | 19 Diciembre 16 | 20 Diciembre 16 | 21 Diciembre 16 | 22 Diciembre 16 | 23 Diciembre 16 |
|--|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP | 3.157,8 | 1.911,8 | 1.472,6 | 1.823,4 | 405,4 |
| 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 | 182,5 | | 41,0 | 174,0 | |
| Tasas de Inter Mínima | 178 d | | 533 d | 350 d | |
| Máxima | 4,15 | | 4,65 | 4,35 | |
| Promedio | 4,26 | | 4,87 | 4,35 | |
| Saldo | 22.974,4 | 22.974,4 | 23.004,4 | 23.034,4 | 23.034,4 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de diciembre de 2016 | 100,0 | | 100,0 | | 100,0 |
| Vencimiento de CD BCRP del 26 al 30 de diciembre de 2016 | 0,0 | | 0,0 | | 0,0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | 300,0 | | 200,0 | 500,0 |
| Plazo de vencimiento | | 720,0 | | 470,0 | 1.348,0 |
| Tasas de Inter Mínima | | 192 d | | 192 d | 3 d |
| Máxima | | 5,51 | | 5,57 | 5,21 |
| Promedio | | 5,86 | | 5,86 | 5,21 |
| Saldo | | 999,0 | | 1.199,0 | 2.399,0 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 08 de mayo de 2017 | | 399,0 | | 399,0 | 399,0 |
| Vencimiento de REPO BCRP del 26 al 30 de diciembre de 2016 | | 300,0 | | 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 | | | | | |
| Vencimiento de Repo Especial - CDR del 26 al 30 de diciembre de 2016 | 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 | | | | | |
| Vencimientos de CDV BCRP del 26 al 30 de diciembre de 2016 | 0,0 | | 0,0 | | 0,0 |
| v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | | | | | |
| Propuestas recibidas | 1.499,9 | 700,0 | 300,0 | 200,0 | |
| Plazo de vencimiento | 2.157,5 | 705,0 | 332,5 | 424,0 | |
| Tasas de Inter Mínima | 1 d | 1 d | 1 d | 1 d | |
| Máxima | 3,70 | 3,50 | 3,65 | 3,65 | |
| Promedio | 4,00 | 4,18 | 3,95 | 3,95 | |
| Saldo | 3,93 | 3,87 | 3,70 | 3,70 | |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el | 2.200,0 | 500,0 | 500,0 | 200,0 | |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo del 26 al 30 de diciembre de 2016 | 1.500,0 | 500,0 | 500,0 | | |
| vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público | | | | | |
| Propuestas recibidas | 200,0 | 300,0 | 300,0 | | 300,0 |
| Plazo de vencimiento | 1.164,0 | 1.429,0 | 1.429,0 | | 1.464,0 |
| Tasas de Inter Mínima | 365 d | 365 d | 365 d | | 368 d |
| Máxima | 5,85 | 5,98 | 5,98 | | 6,06 |
| Promedio | 6,50 | 6,10 | 6,10 | | 6,16 |
| Saldo | 6,09 | 5,99 | 5,99 | | 6,11 |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 08 de junio de 2017 | 1.000,0 | 1.000,0 | 1.300,0 | 1.300,0 | 1.600,0 |
| Vencimiento de Coloc-TP del 26 al 30 de diciembre de 2016 | 0,0 | | 0,0 | | 300,0 |
| 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 26 al 30 de diciembre de 2016 | 0,0 | | 0,0 | | 0,0 |
| viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reutilizables del BCRP (CDR BCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| 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 26 al 30 de diciembre de 2016 | 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 | 14.237,1 | 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 | | 400,0 |
| Vencimiento de REPO del 26 al 30 de diciembre 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 26 al 30 de diciembre 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 26 al 30 de diciembre de 2016 | 0,0 | | 0,0 | | 0,0 |
| xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 1.120,9 | 1.120,9 | 1.120,9 | 1.120,9 | 930,3 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de enero 2017 | 319,9 | | 319,9 | | 285,1 |
| Vencimiento de SC - Venta del 26 al 30 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\$) | | | | | |
| 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 | 0,0 |
| Compras de BTP | | | | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 1.827,8 | 1.511,8 | 1.442,6 | 1.793,4 | 1.905,4 |
| 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 Overnights en moneda nacional | 471,8 | 166,1 | 29,4 | 156,0 | 154,1 |
| 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 | 1.356,0 | 1.345,7 | 1.413,2 | 1.637,4 | 1.751,3 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*) | 8.315,1 | 8.452,8 | 8.234,8 | 8.139,4 | 8.018,5 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 7,2 | 7,4 | 7,2 | 7,2 | 7,1 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 2.951,1 | 2.877,9 | 2.877,9 | 2.801,5 | 2.755,8 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 2,6 | 2,7 | 2,5 | 2,5 | 2,4 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 1.482,0 | 1.353,0 | 1.506,0 | 1.263,0 | 1.165,5 |
| Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio | | | | | |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 4.25/4.30/4.26 | 4.25/4.25/4.25 | 4.25/4.25/4.25 | 4.25/4.55/4.37 | 4.25/4.85/4.61 |
| Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio | 0,0 | | | 0,0 | 0,0 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV | 105,1 | 176,1 | 190,5 | 303,6 | 305,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | 54,0 / 4,34 | | | | |
| Plazo 18 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 16 diciembre 16 | 19 diciembre 16 | 20 diciembre 16 | 21 diciembre 16 | 22 diciembre 16 |
| Flujo de la posición global = a + b - c - j + e + f + g | -61,9 | 46,9 | 13,4 | -3,9 | 84,5 |
| Flujo de la posición contable = a - b - j - c - i + e + g | 9,6 | 21,3 | 99,6 | 40,5 | 86,2 |
| a. Mercado spot con el público | -17,9 | 6,3 | 117,8 | 53,5 | 101,6 |
| i. Compras | 235,5 | 226,6 | 323,3 | 325,4 | 383,9 |
| ii. Ventas | 251,4 | 220,5 | 220,5 | 271,9 | 292,3 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | -52,2 | -115,7 | -37,6 | 37,6 | 48,1 |
| i. Futuros | 36,6 | 127,2 | 162,9 | 162,9 | 132,3 |
| ii. (c) Vencidas | 44,4 | 154,5 | 65,3 | 84,8 | 84,8 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 93,8 | -73,2 | -25,3 | 69,7 | 50,1 |
| i. Futuros | 165,9 | 120,2 | 151,9 | 112,9 | 212,5 |
| ii. (c) Vencidas | 72,1 | 193,4 | 159,3 | 82,2 | 162,5 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 299,8 | 287,0 | 313,0 | 467,4 | 470,7 |
| ii. A futuro | 18,0 | 0,0 | 5,0 | 0,0 | 13,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 58,3 | 70,2 | 70,2 | 70,4 | 70,4 |
| i. Compras | 68,9 | 190,8 | 141,3 | 81,1 | 142,5 |
| ii. (c) Ventas | 10,6 | 120,6 | 144,2 | 57,1 | 72,1 |
| f. Efecto de Opciones | -29,9 | -20,3 | 4,1 | -0,3 | 0,3 |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -3,1 | -16,3 | -11,7 | -20,1 | -8,0 |
| h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,4053 | 3,4065 | 3,4025 | 3,3952 | 3,3967 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |