

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(En millones de S/.)

	11 Dic	12 Dic	13 Dic	14 Dic	15 Dic
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	300.9	258.7	225.0	-21.3	-86.9
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCRP</u>					
i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CDBCRP)</u>					
Propuestas recibidas	203.7	241.4	275.4	0.0	0.0
Propuestas aceptadas	50.0	60.0	85.0	0.0	0.0
Plazo de vencimiento	18 semanas	6 meses	14 semanas	-	-
Tasas de interés					
Mínima	14.47%	14.20%	13.89%	-	-
Máxima	14.47%	14.23%	14.07%	-	-
Promedio	14.47%	14.22%	13.95%	-	-
Saldo de CDBCRP	1 735.1	1 795.1	1 770.1	1 770.1	1 770.1
Próximo vencimiento de CDBCRP (18 de diciembre del 2 000)			100.0		100.0
Vencimientos de CDBCRP del 18 al 22 de diciembre del 2 000			0.0		410.0
ii. <u>Subasta de compra temporal de CDBCRP</u>					
Propuestas recibidas	-	0.0	0.0	93.5	183.5
Propuestas aceptadas	-	0.0	0.0	80.0	170.0
Tasas de interés					
Mínima	-	-	-	10.00%	9.75%
Máxima	-	-	-	11.58%	13.55%
Promedio	-	-	-	11.07%	10.45%
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCRP</u>					
i. <u>Compras (equivalente en millones de S/.)</u>					
Monto (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. <u>Ventas (equivalente en millones de S/.)</u>					
Monto (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP antes del cierre de operaciones					
a. <u>Antes de operaciones de compra temporal de CDBCRP</u>	250.9	198.7	140.0	-21.3	-86.9
b. <u>Con operaciones de compra temporal de CDBCRP</u>	250.9	198.7	140.0	58.7	83.2
4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)</u>	52.9	84.6	8.8	8.8	1.8
Monto (millones de US\$)	15.0	24.0	2.5	2.5	0.5
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.01890%	0.01890%	0.01890%	0.01890%	0.01890%
b. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Monto	-	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	-	-	-	-	-
c. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>					
Monto	-	0.0	6.3	6.5	0.0
Tasa de interés	-	-	6.47%	6.47%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP al cierre de operaciones	303.7	283.3	142.5	61.0	84.9
a. <u>Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)</u>	809.6	821.4	809.1	804.8	802.7
b. <u>Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</u>	7.4	7.5	7.6	7.6	7.5
c. <u>Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)</u>	167.3	176.7	173.1	164.9	159.4
b. <u>Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</u>	1.5	1.6	1.6	1.6	1.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>					
i. Monto	44.3	64.0	59.9	93.7	165.9
ii. Tasas de interés					
Mínima	10.00%	9.00%	10.00%	10.00%	10.00%
Máxima	13.50%	12.50%	13.00%	13.75%	13.75%
Promedio	11.75%	10.55%	11.06%	11.55%	11.00%
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera</u>					
i. Monto	81.5	73.5	73.2	60.1	72.0
ii. Tasas de interés					
Mínima	7.00%	7.00%	7.00%	7.00%	7.00%
Máxima	10.00%	10.00%	10.00%	10.00%	9.00%
Promedio	7.93%	8.04%	8.33%	8.61%	8.41%
c. <u>Mercado secundario de CDBCRP</u>					
i. Monto	5.5	5.5	3.5	-	-
ii. Tasas de interés (rendimiento para el comprador)					
Mínima	14.00%	14.00%	12.25%	-	-
Máxima	14.00%	14.00%	13.25%	-	-
Promedio	14.00%	14.00%	12.67%	-	-
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)					
a. <u>Flujo de la posición de cambios (**)</u>					
i. <u>Compras al contado al público</u>	68.0	72.0	81.7	102.1	93.9
ii. <u>Ventas al contado al público</u>	74.5	70.4	74.6	66.8	103.1
iii. <u>Compras a futuro pactadas con el público</u>	12.2	11.1	-	4.2	1.5
iv. <u>Ventas a futuro pactadas con el público</u>	9.6	18.0	21.2	34.1	17.4
v. <u>Vencimiento de compras a futuro pactadas con el público</u>	4.6	2.5	15.2	1.0	33.4
vi. <u>Vencimiento de ventas a futuro pactadas con el público</u>	9.2	2.4	17.2	3.7	42.5
b. <u>Operaciones cambiarias interbancarias (**)</u>					
i. <u>Al contado</u>	37.3	41.2	54.9	53.1	54.4
ii. <u>A futuro</u>	-	8.0	0.3	2.0	6.4
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
i. Monto	53.0	53.0	53.0	53.0	53.0
ii. Tasa de interés	8.50%	8.50%	8.50%	8.50%	8.50%
* Datos preliminares					
** Datos preliminares para el último día					