

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

| | 7 Diciembre 15 | 9 Diciembre 15 | 10 Diciembre 15 | 11 Diciembre 15 |
|--|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP | 3.213,7 | 3.875,1 | 4.458,0 | 4.108,2 |
| 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 | 200 |
| Plazo de vencimiento | 235,5 | 125,0 | 172,6 | 743 |
| Tasas de interés: Mínima | 185 d | 547 d | 371 d | 91 d |
| Máxima | 4,05 | 4,65 | 4,40 | 3,85 |
| Promedio | 4,10 | 4,94 | 4,49 | 3,90 |
| Saldo | 4,08 | 4,90 | 4,47 | 3,88 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Diciembre de 2015 | 16,971,0 | 17,001,0 | 15,552,9 | 16,629,9 |
| Vencimiento de CD BCRP entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015 | | 1,678,1 | | 600,0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | | | | |
| Propuestas recibidas | 200,0 | 200,0 | | |
| Plazo de vencimiento | 2,4 | | | |
| Tasas de interés: Mínima | 3,55 | | | |
| Máxima | 3,55 | | | |
| Promedio | 3,55 | | | |
| Saldo | 650,0 | 450,0 | 450,0 | 450,0 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 23 de Diciembre de 2015 | | 150,0 | | 150,0 |
| Vencimiento de REPO BCRP entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015 | | 0,0 | | 0,0 |
| iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | | | | |
| Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 26 de Enero de 2016 | 1,900,0 | 1,900,0 | 1,900,0 | 1,900,0 |
| Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015 | | 300,3 | | 300,3 |
| iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | | | | |
| Propuestas recibidas | | | 1,898,8 | 2,000,0 |
| Plazo de vencimiento | | | 2,490,2 | 2,795,6 |
| Tasas de interés: Mínima | | | 1 d | 3 d |
| Máxima | | | 3,10 | 3,38 |
| Promedio | | | 3,48 | 3,71 |
| Saldo | | | 3,46 | 3,66 |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 14 de Diciembre de 2015 | 0,0 | 899,9 | 1,898,8 | 2,000,0 |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015 | | 899,9 | | 2,000,0 |
| v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | | | | |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 18 Diciembre de 2015 | 3,049,9 | 3,049,9 | 3,049,9 | 3,049,9 |
| Vencimiento de Coloc-TP entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015 | | 499,9 | | 499,9 |
| vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | | | | |
| Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016 | 600,0 | 600,0 | 600,0 | 600,0 |
| Vencimiento de Coloc - BN entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015 | | 300,0 | | 300,0 |
| vii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | | | | |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP el 14 de Diciembre de 2015 | 7,135,2 | 7,135,2 | 7,135,2 | 7,135,2 |
| Vencimiento de CDR BCRP entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015 | | 196,0 | | 196,0 |
| viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | | | | |
| Próximo vencimiento de Repo Regular el 15 de Diciembre de 2015 | 15,950,0 | 15,950,0 | 15,950,0 | 15,950,0 |
| Vencimiento de REPO entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015 | | 400,0 | | 400,0 |
| ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | | | | |
| Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017 | 7,900,0 | 7,900,0 | 7,900,0 | 7,900,0 |
| Vencimiento de REPO Expansión entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015 | | 300,0 | | 300,0 |
| x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | | | | |
| Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017 | 4,804,7 | 4,804,7 | 4,804,7 | 4,804,7 |
| Vencimiento de REPO Sustitución entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015 | | 0,0 | | 243,0 |
| xi. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | | | | |
| Propuestas recibidas | 300 | 300 | 150,0 | 300,0 |
| Plazo de vencimiento | 435 | 500 | 150,0 | 475,2 |
| Tasas de interés: Mínima | 91 d | 91 d | 91 d | 91 d |
| Máxima | 0,64 | 0,62 | 0,62 | 0,68 |
| Promedio | 0,68 | 0,63 | 0,75 | 0,69 |
| Saldo | 0,67 | 0,62 | 0,65 | 0,66 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 14 de Diciembre de 2015 | | 26,567,5 | 26,417,6 | 27,049,6 |
| Vencimiento de SC - Venta entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015 | | 299,9 | | 400,0 |
| xii. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neoposición del BCR | | | | |
| i. Compras (millones de US\$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| ii. Ventas (millones de US\$) | | | | |
| Tipo de cambio promedio | | | | |
| Compras (millones de US\$) | | | | |
| Ventas (millones de US\$) | | | | |
| Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$) | | | | |
| i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público | | | | |
| ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público | | | | |
| Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP | | | | |
| i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR | | | | |
| ii. Compras de BTP | | | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 3.583,7 | 2.945,2 | 2.328,2 | 2.031,2 |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps) | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0112% | 0,0104% | 0,0104% | 0,0114% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | | | | |
| Tasa de interés | 4,05% | 4,05% | 4,05% | 4,05% |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | |
| Tasa de interés | 4,05% | 4,05% | 4,05% | 4,05% |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | | | | |
| Tasa de interés | 2,25% | 2,25% | 2,25% | 2,25% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | | | | |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 8.558,5 | 8.322,3 | 8.205,9 | 8.418,8 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 8,6 | 8,5 | 8,4 | 8,1 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 3.543,9 | 3.296,4 | 3.296,4 | 3.125,7 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 3,7 | 3,6 | 3,5 | 3,2 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 1,229,5 | 1,252,5 | 869,5 | 1,155,0 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 3,703,703,70 | 3,693,609,60 | 3,693,609,60 | 3,693,753,71 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 98,0 | 125,0 | 154,0 | 195,0 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV | 0,110,150,14 | 0,150,150,15 | 0,150,150,15 | 0,150,150,15 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | 162,6 | 15,0 | | 1,0 |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 04 Diciembre 15 | 07 Diciembre 15 | 09 Diciembre 15 | 10 Diciembre 15 |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i - e + f + g | 36,7 | 177,2 | -122,4 | 108,3 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii - e + g + d | -52,0 | 27,0 | -3,9 | 18,7 |
| a. Mercado spot con el público | -18,7 | -2,3 | -8,21 | 67,3 |
| b. Compras | 259,0 | 199,9 | 277,4 | 330,2 |
| i. (c) Ventas | 277,7 | 202,9 | 358,5 | 282,9 |
| ii. Compras forward al público (con y sin entrega) | 22,5 | -19,1 | -18,2 | -19,6 |
| i. Pactadas | 198,9 | 47,8 | 186,4 | 67,4 |
| ii. (c) Vencidas | 84,4 | 66,8 | 105,2 | 87,0 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | -39,7 | -41,9 | -95,5 | -100,7 |
| i. Pactadas | 164,5 | 194,5 | 190,7 | 201,0 |
| ii. (c) Vencidas | 204,2 | 269,0 | 95,2 | 301,7 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | |
| i. Al contado | 327,2 | 292,4 | 338,7 | 387,0 |
| ii. A futuro | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 10,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 177,6 | 276,9 | 175,9 | 236,2 |
| i. Compras | 192,7 | 260,1 | 92,6 | 273,4 |
| ii. (c) Ventas | 15,1 | 30,1 | 16,7 | 37,2 |
| f. Efecto de Opciones | | -0,3 | -1,1 | -7,6 |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -64,4 | 127,5 | -10,0 | -55,9 |
| h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | |
| Tasa de interés | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,3712 | 3,3757 | 3,3726 | 3,3748 |
| (*) Datos preliminares | | | | |