

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

Millones de Nuevos Soles

	21 Diciembre 15	22 Diciembre 15	23 Diciembre 15	24 Diciembre 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 614.2	3 793.2	2 500.4	2 126.8
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	27.0	100.0	30.0	30.0
Plazo de vencimiento	89.0	150.0	30.0	66.0
Tasas de interés: Mínima	171 d	179 d	178 d	533 d
Máxima	3.99	4.10	4.89	4.00
Promedio	4.23	4.10	4.35	4.10
Saldo	4.17	4.10	4.30	4.05
Próximo vencimiento de CD BCRP el 30 de Diciembre de 2015	15 805.0	15 835.0	15 580.1	15 680.1
Vencimiento de CD BCRP entre el 28 y el 31 de Diciembre de 2015		300.0		400.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	750.0	750.0	600.0	600.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 4 de Enero de 2016		150.0		300.0
Vencimiento de Repo BCRP entre el 28 y el 31 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	1 900.0	1 900.0	1 900.0	1 900.0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 28 de Enero de 2016		300.3		300.3
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 28 y el 31 de Diciembre de 2015		0.0		0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas	30	940.0	1 200.1	708.0
Plazo de vencimiento	30	940.0	1 317.7	708.0
Tasas de interés: Mínima	14 d	1 d	1 d	1 d
Máxima	3.75	3.65	3.70	3.69
Promedio	3.75	3.73	3.75	3.73
Saldo	3.75	3.74	3.74	3.72
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 28 de Diciembre de 2015	1 730.1	2 170.1	1 402.9	1 279.9
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 28 y el 31 de Diciembre de 2015		2 140.1		1 249.9
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	3 350.0	3 350.0	3 350.0	3 350.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 30 Diciembre de 2015		800.0		800.0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 28 y el 31 de Diciembre de 2015		0.0		800.0
vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	600.0	600.0	600.0	600.0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016		300.0		300.0
Vencimiento de Coloc - BN entre el 28 y el 31 de Diciembre de 2015		0.0		0.0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas	265.0	300	188	300.0
Plazo de vencimiento	91 d	552	204	384.0
Tasas de interés: Mínima	0.48	0.59	0.55	0.58
Máxima	0.70	0.59	0.70	0.59
Promedio	0.60	0.59	0.63	0.58
Saldo	6 520.5	7 008.5	7 139.5	7 209.5
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 29 de Diciembre de 2015		169.0		450.0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 28 y el 31 de Diciembre de 2015		1 419.0		1 065.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas	400.0			450.0
Plazo de vencimiento	1 419.0			1 065.0
Tasas de interés: Mínima	5.31			5.41
Máxima	5.35			5.71
Promedio	5.33			5.60
Saldo	15 650.0	15 650.0	15 200.0	15 200.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 28 de Diciembre de 2015		500.0		300.0
Vencimiento de REPO entre el 28 y el 31 de Diciembre de 2015		900.0		300.0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	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
Vencimiento de REPO Expansión entre el 28 y el 31 de Diciembre de 2015		0.0		0.0
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	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		100
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 28 y el 31 de Diciembre de 2015		0.0		0.0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				
Propuestas recibidas	300	300	300	100
Plazo de vencimiento	537	500	500	100
Tasas de interés: Mínima	91 d	91 d	91 d	123 d
Máxima	0.45	0.50	0.74	0.74
Promedio	0.75	0.75	0.69	0.74
Saldo	0.57	0.72	0.75	0.74
Próximo vencimiento de SC-Venta el 28 de Diciembre de 2015		26 363.6		26 549.6
Vencimiento de SC - Venta entre el 28 y el 31 de Diciembre de 2015		964.0		1 200.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)	0.0	-20.3	-78.1	3 081.0
Tipo de cambio promedio				-33.9
Tipo de cambio promedio		6.0	23.0	10.0
ii. Ventas (millones de US\$)	0.0	3,391.5	3,397.3	3,394.7
Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)		1 266.8		
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público		1 266.8		
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	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	1 892.1	1 024.8	1 154.3	662.9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0104%	0.0104%	0.0104%	0.0104%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	4.05%	4.05%	4.05%	4.30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	4.05%	4.05%	4.05%	4.30%
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	4 599.3	916.2	729.3	711.0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 153.0	7 202.0	7 260.1	7 317.1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.2	7.2	7.1	7.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 336.7	2 272.2	2 116.7	2 068.2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.2	2.3	2.1	2.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 028.5	710.5	1 032.5	1 099.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,75/3,75/3,75	3,75/3,75/3,75	3,75/3,75/3,75	3,75/3,80/3,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	20.0	97.0	135.0	70.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,20/0,25/0,23	0,15/0,25/0,24	0,25/0,30/0,27	0,25/0,25/0,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	50.0	100.0	0.0	0.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	50,0/4,10	100,0/4,10		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	18 Diciembre 15	21 Diciembre 15	22 Diciembre 15	23 Diciembre 15
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 - e + f + g	0,8	34,2	52,4	39,8
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	2,7	55,3	159,9	77,1
a. Mercado spot con el público	-0,8	-51,6	-24,1	-72,2
i. Compras	244,6	231,4	230,7	469,2
ii. (i) Ventas	245,3	283,0	254,9	481,4
iii. Compras forward al público (con y sin entrega)	36,4	-150,9	2,8	14,4
i. Pactadas	161,4	73,9	65,6	147,3
ii. (i) Vencidas	125,0	22,7	85,7	132,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	41,3	-108,0	89,9	23,7
i. Pactadas	276,4	276,4	232,0	299,6
ii. (i) Vencidas	235,0	281,1	146,1	245,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	456,0	427,0	568,8	642,6
ii. A futuro	0,0	0,0	18,0	11,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	23,8	179,1	102,1	207,0
i. Compras	234,4	268,8	145,3	217,0
ii. (i) Ventas	0,6	85,5	42,4	10,0
f. Efecto de Opciones	-6,1	0,6	3,6	4,4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-111,1	0,6	116,4	22,9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3782	3,3822	3,3906	3,3974
(*) Datos preliminares				