

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

Millones de Nuevos Soles

	28 Diciembre 15	29 Diciembre 15	30 Diciembre 15	31 Diciembre 15
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>2 268,3</b>		<b>2 261,7</b>	<b>2 664,3</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>				
<b>a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR</b>				
<b>i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)</b>				
Propuestas recibidas	30,0		30,0	30,0
Plazo de vencimiento	85,0		32,0	110,0
Tasas de interés: Mínima	164 d		526 d	350 d
Máxima	3,85		4,87	4,59
Promedio	4,20		5,10	4,74
Saldo	4,10		5,09	4,69
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de Enero de 2016	15 720,1	15 720,1	15 350,1	15 380,1
Vencimiento de CD BCRP entre el 4 y el 8 de Enero de 2016	400,0	400,0		230,0
<b>ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)</b>				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	600,0	600,0	600,0	600,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 4 de Enero de 2016				
Vencimiento de REPO BCRP entre el 4 y el 8 de Enero de 2016		300,0		300,0
<b>iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)</b>				
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 4 y el 8 de Enero de 2016		0,0		0,0
<b>v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</b>				
Propuestas recibidas	428,0	448,0	371,0	810,3
Plazo de vencimiento	600,1	904,6	591,4	810,3
Tasas de interés: Mínima	1 d	1 d	1 d	4 d
Máxima	3,70	3,65	3,75	3,72
Promedio	3,75	3,75	3,75	3,75
Saldo	1 058,1	1 382,6	992,4	840,3
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 4 de Enero de 2016		1 352,6		840,3
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 4 y el 8 de Enero de 2016		1 352,6		840,3
<b>vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público</b>				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	3 350,0	3 350,0	2 550,0	2 550,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 19 Febrero de 2016		800,0		550,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 4 y el 8 de Enero de 2016		800,0		0,0
<b>vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación</b>				
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 4 y el 8 de Enero de 2016		0,0		0,0
<b>viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)</b>				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	7 209,5	7 059,5	7 059,5	7 059,5
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 4 de Enero de 2016		300,0		300,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 4 y el 8 de Enero de 2016		0,0		0,0
<b>ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)</b>				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	14 900,0	14 900,0	14 900,0	14 900,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 14 de Enero de 2016		300,0		300,0
Vencimiento de REPO entre el 4 y el 8 de Enero de 2016		300,0		0,0
<b>x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)</b>				
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 4 y el 8 de Enero de 2016		0,0		0,0
<b>xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)</b>				
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 28 de Mayo de 2017		243,0		243,0
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 4 y el 8 de Enero de 2016		0,0		0,0
<b>xii. Subasta de Swap Cambio Venta del BCRP</b>				
Propuestas recibidas	200 300 200 150 160	150 843	200 135 175 150 120 100	200 135 175 150 120 100
Plazo de vencimiento	200 600 400 250 210	150 1043	200 140 175 150 120 100	200 140 175 150 120 100
Tasas de interés: Mínima	91 d 120 d 91 d 120 d 63 d	120 d	31 d	29 d 120 d 29 d 120 d 29 d
Máxima	0,54 0,59 0,64 0,75 0,72	0,75	0,69	0,75 0,69 0,74 0,75 0,75 0,75
Promedio	0,74 0,74 0,64 0,75 0,75	0,75	0,75	0,75 0,69 0,75 0,75 0,75 0,75
Saldo	0,64 0,66 0,64 0,75 0,73	0,75	0,75	0,75 0,69 0,74 0,75 0,75 0,75
Próximo vencimiento de SC-Venta el 4 de Enero de 2016		26 602,6		26 351,6
Vencimiento de SC - Venta entre el 4 y el 8 de Enero de 2016		1 131,0		300,0
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neoposición del BCR</b>				
i. Compras (millones de US\$)	-200,8	-204,4	-218,2	-252,6
ii. Tipo de cambio promedio				
iii. Ventas (millones de US\$)	59,0	60,0	64,0	74,0
iv. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	3,4027	3,4071	3,4095	3,4135
L. 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	0,0	0,0	0,0	0,0
L. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP				
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>1 009,4</b>	<b>1 069,4</b>	<b>1 461,1</b>	<b>1 511,4</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0,0104%	0,0104%	0,0103%	0,0103%
Comisión (tasa efectiva diaria)				
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
Tasa de interés	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	380,0	389,8	387,6	109,3
Tasa de interés	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>813,4</b>	<b>903,5</b>	<b>763,5</b>	<b>1 462,1</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 836,2	6 907,6	6 353,9	6 746,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,8	6,9	6,8	6,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 000,4	1 982,4	1 781,4	1 788,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,9	2,0	1,8	1,8
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 445,0	951,0	1 034,0	645,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,75/3,90/3,85	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00	4,00/4,25/4,21
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	30,0	39,0	0,0	110,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,30/0,30/0,30	0,35/0,35/0,35	0,40	0,35/0,35/0,35
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	0,0	40,4	43,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>24 Diciembre 15</b>	<b>28 Diciembre 15</b>	<b>29 Diciembre 15</b>	<b>30 Diciembre 15</b>
Flujo de la posición global = a + b - c - d + e + f + g	42,3	-9,9	60,2	-36,1
Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + f + g	32,6	74,7	17,6	62,5
a. Mercado spot con el público	-14,4	-108,9	-47,6	-125,6
i. Compras	81,8	265,9	277,4	312,1
ii. ( ) Ventas	96,2	374,8	325,0	437,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-17,9	12,4	-20,3	-148,2
i. Pactadas	2,2	189,9	119,7	137,7
ii. ( ) Vencidas	20,1	177,4	140,0	285,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	45,8	24,4	0,7	-133,2
i. Pactadas	86,0	179,0	239,4	240,3
ii. ( ) Vencidas	40,2	153,5	229,7	373,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	139,0	438,7	573,6	568,8
ii. A futuro	0,0	0,0	30,0	15,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	37,5	104,6	169,5	233,0
L. Compras	37,5	141,0	171,0	386,6
ii. ( ) Ventas	0,0	36,4	47,6	133,6
f. Efecto de Opciones	-0,2	-0,2	2,5	6,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	103,3	-17,0	46,4	-47,0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3934	3,4014	3,4077	3,4096
(*) Bases pesimistas				