

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	2 Noviembre 15	3 Noviembre 15	4 Noviembre 15	5 Noviembre 15	6 Noviembre 15
	4,184.6	4,622.9	5,187.7	6,173.8	6,446.4
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP					
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCRP					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	50.0		21.0	30.0	
Próximo vencimiento	215.0		51.0	80.0	
Tasas de interés: Mínima	192.4		554.4	371.4	
Máxima	4.10		4.59	4.45	
Promedio	4.20		4.67	4.45	
Saldo	4.17		4.67	4.45	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Noviembre de 2015	17,848.0	17,848.0	17,889.0	17,524.0	17,524.0
Vencimiento de CD BCRP entre el 9 y el 13 de Noviembre de 2015	375.0		375.0		700.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	375.0		375.0		0.0
Propuestas recibidas					
Próximo vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	450.0	450.0	450.0	450.0	450.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 23 de Diciembre de 2015	150.0		150.0		150.0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 9 y el 13 de Noviembre de 2015	0.0		0.0		0.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas					
Próximo vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2,084.0	2,084.0	2,084.0	2,084.0	2,084.0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 27 de Noviembre de 2015	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 9 y el 13 de Noviembre de 2015	1,184.7		968.4	999.9	2,450.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	500.0	779.8	968.4	200.0	1,438.8
Próximo vencimiento	1.6		1.6		3.4
Tasas de interés: Mínima	3.40	3.30	3.40	3.35	3.38
Máxima	3.48	3.50	3.50	3.50	3.50
Promedio	3.47	3.47	3.47	3.45	3.45
Saldo	3.40	3.47	3.45	3.45	3.45
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 9 de Noviembre de 2015	600.0	779.8	968.4	1,199.9	2,450.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 9 y el 13 de Noviembre de 2015					
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Próximo vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3,049.9	3,049.9	3,049.9	3,049.9	3,049.9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Noviembre de 2015	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 9 y el 13 de Noviembre de 2015	0.0		0.0		0.0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
Próximo vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	600.0	600.0	600.0	600.0	600.0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de Coloc - BN entre el 9 y el 13 de Noviembre de 2015	0.0		0.0		0.0
vii. Subasta de Certificados de Depósitos Reestructurados del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas			29.6	50	165.0
Próximo vencimiento			29.6	115	165.0
Tasas de interés: Mínima			92.4	92.4	92.4
Máxima			0.75	0.44	0.65
Promedio			0.75	0.44	0.67
Saldo	7,233.4	7,233.4	7,313.0	6,913.0	6,714.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 10 de Noviembre de 2015	665.0		665.0		300.0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 9 y el 13 de Noviembre de 2015	86.0		86.0		60.0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resular)					
Propuestas recibidas	300.0		300.0		200.0
Próximo vencimiento	1,050.0		987.0		500.0
Tasas de interés: Mínima	731.4		720.4		51.6
Máxima	4.67		4.60		0.75
Promedio	4.67		4.56		0.75
Saldo	4.76	4.60	4.60	4.69	0.75
Próximo vencimiento de Repo Regular el 16 de Noviembre de 2015	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de REPO entre el 9 y el 13 de Noviembre de 2015	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exansión)					
Propuestas recibidas					
Próximo vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7,900.0	7,900.0	7,900.0	7,900.0	7,900.0
Próximo vencimiento de Repo Exansión el 17 de Enero de 2017	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de REPO Exansión entre el 9 y el 13 de Noviembre de 2015	0.0		0.0		0.0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Próximo vencimiento					
Tasas de interés: 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 entre el 9 y el 13 de Noviembre de 2015	0.0		0.0		0.0
xi. Subasta de Swap: Cambio Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	300.0	220.0	300.0	50.0	83.0
Próximo vencimiento	366.0	220.0	918.3	380.0	120.0
Tasas de interés: Mínima	92.4	92.4	92.4	92.4	92.4
Máxima	0.64	0.70	0.70	0.69	0.75
Promedio	0.74	0.74	0.74	0.69	0.75
Saldo	28,898.3	28,898.3	29,144.0	29,144.0	29,144.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 9 de Noviembre de 2015	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de SC - Venta entre el 9 y el 13 de Noviembre de 2015	790.0		330.0		1,300.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0.0	0.0	-39.5	-108.9	-298.3
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0.0	0.0	3,295.3	3,304.4	3,314.2
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	0.0
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3,844.6	4,142.2	4,048.2	4,670.0	3,298.2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0.0107%	0.0107%	0.0107%	0.0107%	0.0106%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2.25%	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	3,787.7	4,136.2	4,339.5	4,379.7	2,933.5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	6,007.0	7,236.3	7,411.2	7,909.0	7,795.1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.7	7.9	7.7	8.2	8.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2,199.2	2,199.2	2,609.3	3,151.9	2,997.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.6	2.8	2.7	3.1	3.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	496.0	790.5	747.2	810.5	389.8
Tasas de interés: Mínima/Máxima/Promedio	3,503,503.50	3,503,503.50	3,503,503.50	3,503,503.50	3,503,503.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	88.0	187.0	202.0	161.0	161.0
Tasas de interés: Mínima/Máxima/Promedio	0.150,150.15	0.150,200.15	0.150,200.19	0.200,200.20	0.200,200.20
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Próximo vencimiento (monto / tasa promedio)					
Próximo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Próximo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	30 Octubre 15	02 Noviembre 15	03 Noviembre 15	04 Noviembre 15	05 Noviembre 15
Flujo de la posición global = a + b + c + e + f + g	-5.7	-60.3	-37.5	6.1	-139.0
Flujo de la posición contable = a + b + c + d + e + f + g	64.4	-190.9	-152.2	-71.2	-129.6
a. Mercado spot con el público	247.3	293.6	-172.6	-159.3	-67.5
i. Compras	266.1	141.3	194.9	199.9	275.2
ii. (i) Ventas	902.3	434.9	367.5	288.4	342.7
ii. (ii) Ventas forward al público (con y sin entrega)	-74.7	113.6	153.3	-15.9	-27.0
iii. Pagadas	233.3	227.2	228.8	228.8	192.8
iv. (i) Vencidas	388.0	113.5	125.3	245.7	188.3
v. (ii) Vencidas	-32.1	63.9	10.4	5.8	-35.1
vi. Pagadas	167.6	177.2	246.6	176.8	100.6
vii. Vencidas	199.8	113.3	238.2	171.1	135.8
b. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	237.9	282.3	618.0	386.4	495.5
ii. A futuro	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
c. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	132.7	148.2	148.2	-22.6	-12.5
d. Compras	194.8	112.7	194.8	167.6	130.0
e. (i) Ventas	62.3	69.6	69.6	190.1	147.5
e. (ii) Ventas	44.2	102.5	1.1	43.5	25.1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0.9	8.9	-46.0	140.5	-112.7
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Igual por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Igual por regulación monetaria promedio (Fuente: Databe)					
8. Totales	3,295.8	3,296.2	3,296.4	3,295.3	3,301.5