

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

		Millones de Moneda Nacional				
		16 Noviembre 15	17 Noviembre 15	18 Noviembre 15	19 Noviembre 15	20 Noviembre 15
		4,455.4	4,247.2	3,996.3	3,978.8	3,665.6
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 BCR						
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)						
Propuestas recibidas		30.0		30.0		30.0
Plazo de vencimiento		182.0		140.0		140.0
Tasas de interés: Mínima		4.07		4.75		3.97
Máxima		4.07		4.75		4.39
Promedio		4.06		4.75		4.39
Saldo		16,936.0		16,960.0		16,996.0
ii. Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de Diciembre de 2015						
Vencimiento de CD BCRP entre el 23 y el 27 de Noviembre de 2015		900.0		900.0		900.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)						
Propuestas recibidas		0.0		0.0		0.0
Plazo de vencimiento		0.0		0.0		0.0
Tasas de interés: Mínima		0.0		0.0		0.0
Máxima		0.0		0.0		0.0
Promedio		0.0		0.0		0.0
Saldo		450.0		450.0		450.0
iv. Próximo vencimiento de Repo de Valores el 23 de Diciembre de 2015						
Vencimiento de REPO BCRP entre el 23 y el 27 de Noviembre de 2015		150.0		150.0		150.0
v. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)						
Propuestas recibidas		0.0		0.0		0.0
Plazo de vencimiento		0.0		0.0		0.0
Tasas de interés: Mínima		0.0		0.0		0.0
Máxima		0.0		0.0		0.0
Promedio		0.0		0.0		0.0
Saldo		2,084.0		2,084.0		2,084.0
vi. Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 27 de Noviembre de 2015						
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 23 y el 27 de Noviembre de 2015		500.0		500.0		500.0
vii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional						
Propuestas recibidas		3,394.1		3,100.0		2,700.0
Plazo de vencimiento		1.4		1.4		1.4
Tasas de interés: Mínima		3.40		3.40		3.40
Máxima		3.50		3.50		3.50
Promedio		3.48		3.48		3.47
Saldo		3,300.0		3,100.0		2,700.0
viii. Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 23 de Noviembre de 2015						
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 23 y el 27 de Noviembre de 2015		3,300.0		2,700.0		2,231.1
ix. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público						
Propuestas recibidas		0.0		0.0		0.0
Plazo de vencimiento		0.0		0.0		0.0
Tasas de interés: Mínima		0.0		0.0		0.0
Máxima		0.0		0.0		0.0
Promedio		0.0		0.0		0.0
Saldo		3,049.9		3,049.9		3,049.9
x. Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Noviembre de 2015						
Vencimiento de Coloc-TP entre el 23 y el 27 de Noviembre de 2015		300.0		300.0		300.0
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación						
Propuestas recibidas		0.0		0.0		0.0
Plazo de vencimiento		0.0		0.0		0.0
Tasas de interés: Mínima		0.0		0.0		0.0
Máxima		0.0		0.0		0.0
Promedio		0.0		0.0		0.0
Saldo		600.0		600.0		600.0
xii. Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016						
Vencimiento de Coloc - BN entre el 23 y el 27 de Noviembre de 2015		300.0		300.0		300.0
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reestructurados del BCRP (CDR BCRP)						
Propuestas recibidas		0.0		0.0		0.0
Plazo de vencimiento		0.0		0.0		0.0
Tasas de interés: Mínima		0.0		0.0		0.0
Máxima		0.0		0.0		0.0
Promedio		0.0		0.0		0.0
Saldo		7,136.0		7,136.0		6,936.0
xiv. Próximo vencimiento de CDR BCRP el 27 de Noviembre de 2015						
Vencimiento de CDR BCRP entre el 23 y el 27 de Noviembre de 2015		200.0		200.0		500.1
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)						
Propuestas recibidas		896.0		896.0		799.4
Plazo de vencimiento		7.6		7.6		7.6
Tasas de interés: Mínima		4.56		4.56		4.81
Máxima		4.86		4.86		4.86
Promedio		4.72		4.72		4.67
Saldo		16,550.0		16,550.0		16,550.0
xvi. Próximo vencimiento de Repo Regular el 27 de Noviembre de 2015						
Vencimiento de REPO entre el 23 y el 27 de Noviembre de 2015		500.0		500.0		500.0
xvii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Excepción)						
Propuestas recibidas		0.0		0.0		0.0
Plazo de vencimiento		0.0		0.0		0.0
Tasas de interés: Mínima		0.0		0.0		0.0
Máxima		0.0		0.0		0.0
Promedio		0.0		0.0		0.0
Saldo		7,900.0		7,900.0		7,900.0
xviii. Próximo vencimiento de Repo Excepción el 17 de Enero de 2017						
Vencimiento de REPO Excepción entre el 23 y el 27 de Noviembre de 2015		300.0		300.0		300.0
xix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)						
Propuestas recibidas		0.0		0.0		0.0
Plazo de vencimiento		0.0		0.0		0.0
Tasas de interés: Mínima		0.0		0.0		0.0
Máxima		0.0		0.0		0.0
Promedio		0.0		0.0		0.0
Saldo		4,804.7		4,804.7		4,804.7
xx. Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017						
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 23 y el 27 de Noviembre de 2015		243.0		243.0		243.0
xi. Subasta de Swap: Cambio Venta del BCRP						
Propuestas recibidas		60.0 200.0 300.0 299.9 99.0		300 0 128		300 300 300 300
Plazo de vencimiento		60.0 684.0 547.0 434.9 99.0		326 128		520 316 800 70
Tasas de interés: Mínima		0.75 0.49 0.30 0.60 0.65		0.65 0.65		0.65 0.64 0.19 0.20
Máxima		0.75 0.65 0.69 0.75 0.75		0.75 0.75		0.75 0.69 0.59 0.20
Promedio		0.75 0.57 0.43 0.73 0.68		0.68		0.65 0.66 0.26 0.20
Saldo		25,412.4		25,430.4		25,521.4
xii. Próximo vencimiento de SC-Venta el 23 de Noviembre de 2015						
Vencimiento de SC - Venta entre el 23 y el 27 de Noviembre de 2015		410.0		313.0		860.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR						
i. Compras (millones de US\$)						
Tipo de cambio promedio		2,350.0		1,214.0		1,214.0
ii. Ventas (millones de US\$)		-234.2		-167.4		-13.4
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)						
Compras (millones de US\$)		3,349.9		3,347.6		3,350.0
Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público		0.0		0.0		0.0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP						
Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR		0.0		0.0		0.0
Ventas de BTP		0.0		0.0		0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones						
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones						
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)						
Comisión (base efectiva diaria)		0.0100%		0.0100%		0.0110%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)						
Tasa de interés		4.05%		4.05%		4.05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional						
Tasa de interés		4.05%		4.05%		4.05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional						
Tasa de interés		2.95%		2.95%		2.95%
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/.) (*)						
Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)		7,245.3		7,452.2		7,020.9
b. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)						
Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)		2,429.1		2,396.5		2,196.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (v)						
		2.6		2.5		2.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP						
a. Operaciones a la vista en moneda nacional						
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		620.0 / 3,503,503.50 / 0.00		746.0 / 3,503,503.50 / 0.00		681.0 / 3,503,503.50 / 0.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)						
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		307.0 / 0.00 / 0.00		314.0 / 0.00 / 0.00		117.2 / 0.00 / 0.00
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV						
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		0.200,250,22		0.200,250,21		0.200,250,21
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		0.0		0.0		0.0
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)		0.0		0.0		0.0
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)						
a. Flujo de la posición global - a = b + c + e + f + g						
Flujo de la posición contable - a = b + c + e + f + g		53.9		129.7		-46.4
b. Mercado spot con el público						
Compras		51.0		19.2		47.3
Ventas		-127.1		-147.4		-155.0
c. Operaciones forward al público (con y sin entrega)						
Compras		284.4		296.6		232.6
Ventas		331.5		384.0		297.7
d. Operaciones forward al público (con y sin entrega)						
Compras		64.5		45.2		22.6
Ventas		136.8		129.7		76.8
e. Operaciones cambiarias interbancarias						
Compras		72.2		79.2		114.7
Ventas		72.2		54.2		49.4
f. Operaciones cambiarias interbancarias						
Compras		199.8		277.1		301.7
Ventas		199.8		277.1		301.7
g. Operaciones cambiarias interbancarias						
Compras		349.4		379.0		251.4
Ventas		176.8		159.9		115.9
h. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega						
Compras		199.7		271.5		258.9
Ventas		22.9		43.0		68.4
i. Efecto de Docenas						
Compras		4.4		12.9		10.1
Ventas		135.5		206.9		63.7
j. Operaciones netas con otras instituciones financieras						
Compras		0.0		0.0		0.0
Ventas		0.0		0.0		0.0
k. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera						
Tasa de interés		0.0		0.0		0.0
l. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera						
Tasa de interés		0.0		0.0		0.0
Neto: Igual por regulación monetaria en moneda extranjera						
Neto: Igual por regulación monetaria en moneda extranjera		3,333.3		3,340.3		3,367.1
8. Bases cambiarias						
Bases cambiarias		3,333.3		3,340.3		3,367.1