BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	23 Noviembre 15	24 Noviembre 15	25 Noviembre 15	26 Noviembre 15	27 Noviembre 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**3 664,4**	**2 693,9**	**2 979,9**	**3 292,2**	**1 895,0**
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	30 200 200 150		30 200 30	30 35	
Plazo de vencimiento	182 410 325 210		40 220 60	115 129	
Tasas de interés: Mínima	171 d 366 d 366 d 7 d		533 d 364 d 182 d	350 d 181 d	
Máxima	3,75 4,35 4,35 3,48		4,91 4,55 4,25	4,60 4,25	
Promedio	4,09 4,35 4,79 3,48		4,91 4,55 4,25	4,60 4,25	
Saldo	4,06 4,35 4,62 3,48		4,91 4,55 4,25	4,60 4,25	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 30 de Noviembre de 2015	17 576,0	17 576,0	17 836,0	17 901,0	17 901,0
Vencimiento de CD BCRP entre el 30 de Noviembre y el 4 de Diciembre de 2015	900,0		150,0		150,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	0,0		0,0		0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de 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 30 de Noviembre y el 4 de Diciembre de 2015	0,0		0,0		0,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					500,0
Propuestas recibidas					650,0
Plazo de vencimiento					91 d
Tasas de interés: Mínima					4,46
Máxima					4,79
Promedio					4,60
Saldo	2 084,0	2 084,0	2 084,0	2 084,0	2 084,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 30 de Noviembre de 2015	500,0		500,0		200,3
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 30 de Noviembre y el 4 de Diciembre de 2015	500,0		500,0		1 285,6
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	1 200,2	500 ,0 1180,6	405,2 1214,1	372,6 294,0 1432,9	434,9 603
Propuestas recibidas	1 227,7	663 ,5 1180,6	405,2 1214,1	372,6 294,0 1432,9	434,9 603
Plazo de vencimiento	1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	3,40	3,47 3,42	3,48 3,43	3,48 3,49 3,40	3,48 3,40
Máxima	3,50	3,50 3,50	3,50 3,50	3,50 3,50 3,50	3,50 3,50
Promedio	3,47	3,49 3,48	3,50 3,47	3,50 3,50 3,48	3,49 3,48
Saldo	1 200,2	1 680,6	1 619,3	2 099,5	1 037,9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 30 de Noviembre de 2015	1 200,2		1 619,3		1 037,9
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 30 de Noviembre y el 4 de Diciembre de 2015	1 200.2		1 619.3		1 037.9
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					300.0
Propuestas recibidas					904,1
Plazo de vencimiento					182 d
Tasas de interés: Mínima					5.05
Máxima					7,03
Promedio					5,73
Saldo	3 049.9	3 049.9	3 049.9	3 049.9	3 049.9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 18 Diciembre de 2015	300,0		300,0		499,9
Vencimiento de Coloc-TP entre el 30 de Noviembre y el 4 de Diciembre de 2015	300.0		300.0		
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	600.0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el de 20 Mayo de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Coloc - BN entre el 30 de Noviembre y el 4 de Diciembre de 2015	0,0		0,0		0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	383,7				
Propuestas recibidas	402,4				
Plazo de vencimiento	25 d				
Tasas de interés: Mínima	0,34				
Máxima	0,75				
Promedio	0,49				
Saldo	7 318.7	7 318.7	7 318.7	7 318.7	7 318.7
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 14 de Diciembre de 2015	500,6		500,6		196,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 30 de Noviembre y el 4 de Diciembre de 2015	500,6		500,6		0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					200,0
Propuestas recibidas					1 165,0
Plazo de vencimiento					731 d
Tasas de interés: Mínima					4,83
Máxima					4,93
Promedio					4,89
Saldo	16 550.0	16 550.0	16 550.0	16 550.0	16 250.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 14 de Diciembre de 2015	500,0		500,0		1 000,0
Vencimiento de REPO entre el 30 de Noviembre y el 4 de Diciembre de 2015	500,0		500,0		1 500,0
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	7 900,0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 17 de Enero de 2017	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 30 de Noviembre y el 4 de Diciembre de 2015	0,0		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	4 804,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 26 de Mayo de 2017	243,0		243,0		243,0
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 30 de Noviembre y el 4 de Diciembre 2015	0,0		0,0		0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300 100 300 200	100 66	550 85 165 99	150 300	
Propuestas recibidas	365 165 493 250	200 66	850 85 165 99	150 300	
Plazo de vencimiento	92 d 92 d 92 d 93 d	92 d 62 d	92 d 92 d 61 d 61 d	92 d 61 d	
Tasas de interés: Mínima	0,75 0,75 0,49 0,75	0,75 0,75	0,75 0,75 0,60 0,75	0,75 0,73	
Máxima	0,75 0,75 0,75 0,75	0,75 0,75	0,75 0,75 0,75 0,75	0,75 0,75	
Promedio	0,75 0,75 0,59 0,75	0,75 0,75	0,75 0,75 0,69 0,75	0,75 0,74	
Saldo	25 860,4	25 378,4	25 642,5	26 092,5	26 092,5
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de Noviembre de 2015	648,0		400,0		400,0
Vencimiento de SC - Venta entre el 30 de Noviembre y el 4 de Diciembre de 2015	1 282,9		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-290,3	-135,0	-111,6	-135,1	0,0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	86,0	40,0	33,0	40,0	
Tipo de cambio promedio	3.3761	3.3760	3.3809	3.3774	3.3774
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP. CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**1 050,1**	**878,2**	**989,1**	**992,6**	**1 357,1**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0104%	0,0104%	0,0104%	0,0104%	0,0114%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	514,5	311,2	229,6	290,4	786,0
Tasa de interés	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**535,6**	**567,0**	**759,5**	**702,2**	**571,1**
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	6 840,3	6 781,9	6 735,9	6 691,2	6 645,0
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,0	7,0	6,9	6,9	6,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 967.8	1 909.4	1 863.4	1 818.7	1 772.5
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	2,0	1,9	1,9	1,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 009.0	727.0	1 005.0	959.0	584.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	183.0	34.0	43.0	37.0	37.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.15/0.15/0.15	0.15/0.15/0.15	0.15/0.19/0.15	0.15/0.15/0.15	0.15/0.15/0.15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	0.0		158.3	108,1
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				120/4.55	108.1/4.56
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**20 Noviembre 15**	**23 Noviembre 15**	**24 Noviembre 15**	**25 Noviembre 15**	**26 Noviembre 15**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	97,5	-22,4	-139,2	113,3	70,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	44,1	142,6	-79,7	-23,3	-43,3
a. Mercado spot con el público	-95,1	-124,0	-150,2	-92,2	-114,5
i. Compras	196,5	175,5	181,3	189,6	190,9
ii. (-) Ventas	291,6	299,5	331,5	281,7	305,3
b. Compras forward al público (con v sin entrega)	-44,8	-29,5	-101,4	7,4	9,7
i. Pactadas	90,7	53,3	97,2	52,1	69,6
ii. (-) Vencidas	135,5	82,8	198,6	44,7	59,9
c. Ventas forward al público (con v sin entrega)	-8,8	156,8	-218,5	-44,8	23,4
i. Pactadas	230,1	214,2	158,4	241,4	95,6
ii. (-) Vencidas	238,9	57,4	376,9	286,2	72,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	406,0	220,1	389,0	321,0	399,0
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	233,8	40,3	217,6	283,6	45,5
i. Compras	237,2	51,7	355,5	285,4	71,9
ii. (-) Ventas	3,4	11,4	137,9	1,8	26,4
f. Efecto de Opciones	8,1	19,3	-28,0	13,4	-5,9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	90,2	202,9	-117,4	97,9	171,1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3597	3,3760	3,3761	3,3827	3,3775

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera