

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	7 Diciembre 15	9 Diciembre 15	10 Diciembre 15	11 Diciembre 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3.213,7	3.875,1	4.458,0	4.108,2
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	30,0	30,0	30	200
Plazo de vencimiento	235,5	125,0	172,6	743
Tasas de interés: Mínima	185 d	547 d	371 d	91 d
Máxima	4,05	4,65	4,40	3,85
Promedio	4,10	4,94	4,49	3,90
Saldo	4,08	4,90	4,47	3,88
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Diciembre de 2015	16,971,0	17,001,0	15,552,9	15,629,9
Vencimiento de CD BCRP entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015		1,678,1		600,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas	200,0	200,0		
Plazo de vencimiento	2,4			
Tasas de interés: Mínima	3,55			
Máxima	3,55			
Promedio	3,55			
Saldo	650,0	450,0	450,0	450,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 23 de Diciembre de 2015		150,0		150,0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 14 y el 18 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				
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 26 de Enero de 2016	1,900,0	1,900,0	1,900,0	1,900,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015		300,3		300,3
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas		889,8	1,898,8	2,000,0
Plazo de vencimiento		1,932,6	2,490,2	2,795,6
Tasas de interés: Mínima		1 d	1 d	3 d
Máxima		3,10	3,10	3,10
Promedio		3,48	3,47	3,71
Saldo	0,0	3,46	3,45	3,66
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 14 de Diciembre de 2015		899,9	1,898,8	2,000,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015		899,9		2,000,0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	3,049,9	3,049,9	3,049,9	3,049,9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 18 Diciembre de 2015		499,9		499,9
Vencimiento de Coloc-TP entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015		0,0		499,9
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 14 y el 18 de Diciembre de 2015		0,0		0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	7,135,2	7,135,2	7,135,2	7,135,2
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 14 de Diciembre de 2015		196,0		196,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015		0,0		578,7
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas	200,0	810,0		
Plazo de vencimiento	731 d			
Tasas de interés: Mínima	4,95			
Máxima	4,97			
Promedio	4,96			
Saldo	15,950,0	15,950,0	15,950,0	15,950,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 15 de Diciembre de 2015		400,0		400,0
Vencimiento de REPO entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015				2,200,0
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 14 y el 18 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		243,0
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015		0,0		300,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				
Propuestas recibidas	300	300	150,0	300,0
Plazo de vencimiento	435	500	150,0	475,2
Tasas de interés: Mínima	91 d	91 d	91 d	91 d
Máxima	0,64	0,62	0,62	0,68
Promedio	0,68	0,63	0,75	0,69
Saldo	0,67	0,62	0,65	0,66
Próximo vencimiento de SC-Venta el 14 de Diciembre de 2015		26,567,5	26,417,6	27,049,6
Vencimiento de SC - Venta entre el 14 y el 18 de Diciembre de 2015		299,9		400,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neoposición del BCR				
i. Compras (millones de US\$)	0,0	567,9	0,0	2,313,0
ii. Ventas (millones de US\$)				0,0
iii. Tipo de cambio promedio				
iv. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)				
L. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0
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				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3.583,7	2.945,2	2.328,2	2.031,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0,0112%	0,0104%	0,0104%	0,0114%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Comisión (tasa efectiva diaria)				
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1,341,2	566,0	122,7	612,4
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	2.242,9	2.219,2	2.035,9	1.418,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/), (*)	8.558,5	8.322,3	8.319,1	8.026,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,6	8,5	8,4	8,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,543,9	3,296,4	3,296,4	3,125,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,7	3,6	3,5	3,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1,229,5	1,252,5	869,5	1,155,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,703/703,70	3,693/609,60	3,503/503,50	3,693/753,71
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	98,0	125,0	154,0	195,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,1/0,15/0,14	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	162,6	15,0		1,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	04 Diciembre 15	07 Diciembre 15	09 Diciembre 15	10 Diciembre 15
Flujo de la posición global = a + b - c - d - e + f + g	36,7	177,2	-122,4	108,3
Flujo de la posición contable = a + b - c - d - e + f + g	-52,0	27,0	-3,9	18,7
a. Mercado spot con el público	-18,7	-2,3	-8,21	67,3
b. Compras	259,0	199,9	277,4	330,2
i. (c) Ventas	277,7	202,9	358,5	282,9
ii. Compras forward al público (con y sin entrega)	22,5	-19,1	186,4	-19,6
i. Pactadas	198,9	47,8	186,4	67,4
ii. (c) Vencidas	84,4	66,8	105,2	87,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-39,7	-41,9	95,5	-100,7
i. Pactadas	164,5	227,1	190,7	201,0
ii. (c) Vencidas	204,2	269,0	95,2	301,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	327,2	292,4	338,7	387,0
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	10,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	177,6	276,9	175,9	236,2
L. Compras	192,7	260,1	92,6	273,4
ii. (c) Ventas	15,1	30,1	16,7	37,2
f. Efecto de Opciones		-0,3	-1,1	-7,6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-64,4	127,5	-10,0	-55,9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3712	3,3757	3,3726	3,3748
(*) Datos preliminares				