

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Sol)

	14 Diciembre 15	15 Diciembre 15	16 Diciembre 15	17 Diciembre 15	18 Diciembre 15	
	4 774.1	4 626.1	4 181.4	4 181.4	2 157.3	
1 Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP						
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)	30.1 30.1 178.4 4.03 4.09 4.07	400.0 400.0 178.4 4.05 4.20 4.16	200 460 86.4 3.96 4.00 3.99	300 460 178.4 4.00 4.26 4.16	300 460 178.4 4.00 4.26 4.16	130.0 180.0 383.4 4.59 4.75 4.88
Saldo Promedio	15 480.0	15 960.0	15 960.0	15 188.0	15 678.0	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 23 de Diciembre de 2015	1 080.0			1 080.0	300.0	
Vencimiento de CD BCRP entre el 21 y el 24 de Diciembre de 2015	1 080.0			1 080.0	300.0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de interés: Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	450.0	450.0	450.0	450.0	150.0	
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 23 de Diciembre de 2015	150.0				150.0	
Vencimiento de REPO BCRP entre el 21 y el 24 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	1 900.0	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 21 y el 24 de Diciembre de 2015	0.0				0.0	
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	3 000.0	2 600.1	2 600.0	2 477.5	2 400.0	
Propuestas recibidas	3 080.6	2 696.5	2 627.4	2 477.5	2 425.0	
Plazo de vencimiento	1.4	1.4	1.4	1.4	1.4	
Tasas de interés: Mínima	3.40	3.62	3.63	3.65	3.66	
Máxima	3.74	3.73	3.72	3.74	3.74	
Promedio	3.68	3.69	3.68	3.70	3.71	
Saldo	3 000.0	2 600.1	2 300.0	2 477.5	2 400.0	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 21 de Diciembre de 2015	3 000.0				2 400.0	
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 21 y el 24 de Diciembre de 2015	3 000.0				2 400.0	
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	3 349.9	3 349.9	3 300.0	
Próximo vencimiento de Repo de Colocación DP el 30 de Diciembre de 2015	499.9				499.9	
Vencimiento de Colocación DP entre el 21 y el 24 de Diciembre de 2015	499.9				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	600.0	
Próximo vencimiento de Colocación DP el 20 Mayo de 2016	300.0				300.0	
Vencimiento de Colocación DP entre el 21 y el 24 de Diciembre de 2015	0.0				0.0	
viii. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de interés: Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	6 939.2	6 939.2	6 939.2	6 939.2	6 555.5	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 23 de Diciembre de 2015	383.7				383.7	
Vencimiento de CDR BCRP entre el 21 y el 24 de Diciembre de 2015	383.7				480.0	
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reposur)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de interés: Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	15 950.0	15 950.0	15 950.0	15 950.0	15 650.0	
Próximo vencimiento de Repo Reposur el 21 de Diciembre de 2015	400.0				400.0	
Vencimiento de REPO Reposur entre el 21 y el 24 de Diciembre de 2015	2 200.0				1 300.0	
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansion)						
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	
Vencimiento de REPO Expansion entre el 21 y el 24 de Diciembre de 2015	0.0				0.0	
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitucion)						
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	
Vencimiento de REPO Sustitucion entre el 21 y el 24 de Diciembre de 2015	0.0				0.0	
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300.0			300	300	
Propuestas recibidas	480.0			680	514	
Plazo de vencimiento	91.0			91.0	91.0	
Tasas de interés: Mínima	0.55			0.49	0.46	
Máxima	0.99			0.98	0.60	
Promedio	0.68			0.55	0.53	
Saldo	26 846.6	26 634.6	26 334.6	26 286.6	26 286.6	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 21 de Diciembre de 2015	315.0			696.0	791.0	
Vencimiento de SC - Venta entre el 21 y el 24 de Diciembre de 2015	1 913.0			1 288.0	2 487.0	
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR						
i. Compras (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	
ii. Ventas (millones de US\$)						
Tipo de cambio promedio	4 804.7	4 804.7	4 804.7	4 804.7	4 804.7	
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						
c. 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	1 344.0	1 324.0	1 390.9	1 685.5	1 127.3	
4 Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones						
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0.0114%	0.0104%	0.0104%	0.0104%	0.0114%	
Comisión (base efectiva diaria)						
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%	
Tasa de interés	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%	
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	39.9	118.8	252.9	465.0	61.3	
Tasa de interés	2.9%	2.9%	2.9%	2.9%	2.9%	
d. Depósitos Overnight en moneda nacional						
Tasa de interés						
5 Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 394.1	1 329.3	1 390.9	1 685.5	1 666.0	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (Millones de S/)	7 719.3	7 830.7	7 571.4	7 571.4	7 413.9	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.8	7.9	7.5	7.4	7.4	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (Millones de S/)	2 800.1	2 673.8	2 577.8	2 579.9	2 462.0	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.8	2.9	2.6	2.6	2.6	
6 Mercado interbancario y mercado secundario de CD BCRP						
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	514.5	547.0	699.5	880.0	1 137.0	
Tasas de interés: Mínima	3,753,753,75	3,753,753,75	3,753,753,75	3,753,753,75	3,753,803,76	
Máxima						
Promedio						
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	33.0	167.0	167.0	144.0	144.0	
Tasas de interés: Mínima	0.150,150,15	0.150,150,15	0.150,150,15	0.150,150,15	0.150,150,15	
Máxima						
Promedio						
c. Total mercado secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y CDV	0.0	3.0	173.0	150.0	150.0	
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\$)	11 Diciembre 15	14 Diciembre 15	15 Diciembre 15	16 Diciembre 15	17 Diciembre 15	
Flujo de la posición global = a + b + c + e + f + g	21.0	15.9	8.7	-42.8	23.7	
Flujo de la posición contable = a + b + c + d + e + f + g	-81.6	-154.2	-55.1	48.8	31.5	
a. Mercado spot con el público	-195.4	-147.9	-13.9	-7.9	8.3	
i. Compras	266.1	255.1	255.1	248.5	249.0	
ii. (i) Ventas	441.5	412.0	241.1	256.4	239.3	
b. Compra forward al público (con y sin entrega)	47.7	148.1	69.5	61.0	0.9	
ii. Paquetes	192.9	210.4	135.8	166.9	166.9	
(i) Vencidas	145.2	352.4	66.3	61.1	160.0	
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	133.4	334.5	18.3	72.8	-6.7	
i. Paquetes	356.4	243.6	221.8	259.9	311.6	
ii. (i) Vencidas	223.0	578.1	187.0	187.0	320.3	
d. Operaciones cambiarias interbancarias						
Al contado	333.5	302.5	177.7	272.1	293.0	
ii. A futuro	0.0	3.0	8.0	15.0	0.0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	149.3	179.5	182.7	179.5	199.3	
i. Compras	215.7	575.6	203.5	203.5	317.6	
ii. (i) Ventas	66.3	296.4	0.3	10.8	118.3	
f. Efecto de Decreas	2.8	15.6	3.1	10.8	0.9	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	187.6	-88.9	-95.6	-33.5	-33.5	
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera						
Tasa de interés						
Nota: Igual por regulación monetaria en moneda extranjera						
Neto: Igual por regulación monetaria promedio (Fuente: Databank)						
N) Bases contractuales	3,3796	3,3801	3,3745	3,3955	3,3748	