

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Sol)

	1 Febrero 16	2 Febrero 16	3 Febrero 16	4 Febrero 16	5 Febrero 16
	3 881,9	3 896,8	3 928,3	4 735,5	3 759,8
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)					
Propuestas recibidas	30,0	100,0	0,2	30,0	100,1
Plazo de vencimiento	132,0	132,0	15,2	98,0	208,1
Tasas de interés: Mínima	192,0	373,4	554,4	371,4	370,4
Máxima	4,50	4,50	4,05	4,90	4,08
Promedio	4,50	4,50	4,10	4,90	4,90
Saldo	15 733,2	15 831,2	15 831,4	15 861,4	15 961,5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de Febrero de 2016	1 050,0		1 050,0		1 050,0
Vencimiento de CD BCRP entre el 8 y el 12 de Febrero de 2016	0,0		0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 17 de Junio de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 8 y el 12 de Febrero de 2016	0,0		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	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 26 de Febrero de 2016	500,8		500,8		500,8
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 8 y el 12 de Febrero de 2016	0,0		0,0		0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas		350,0	350,1	500,1	499,9
Plazo de vencimiento		876,0	758,0	907,5	1 181,5
Tasas de interés: Mínima		1,4	1,4	1,4	3,4
Máxima		3,70	3,88	3,92	3,95
Promedio		3,97	3,97	3,97	3,97
Saldo		3,95	3,93	3,95	3,98
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 8 de Febrero 2016		350,0	350,1	1 322,4	1 253,2
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 8 y el 12 de Febrero de 2016					
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 050,0	3 050,0	3 050,0	3 050,0	3 050,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 19 de Febrero de 2016	550,0		550,0		550,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 8 y el 12 de Febrero de 2016	0,0		0,0		0,0
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 20 Mayo de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Coloc - BN entre el 8 y el 12 de Febrero de 2016	0,0		0,0		0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Resuables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas		129	129		
Plazo de vencimiento		129	156		
Tasas de interés: Mínima		0,75	0,75		
Máxima		0,75	0,75		
Promedio		0,75	0,75		
Saldo	7 855,5	7 935,5	7 935,5	7 855,5	7 850,6
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 8 de Febrero de 2016	78,6		78,6		100,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 8 y el 12 de Febrero de 2016	244,6		244,6		926,0
ix. Compra con compromiso de Reconquista de moneda extranjera (Reoular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	14 400,0	14 400,0	14 400,0	14 400,0	14 000,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 14 de Abril de 2016	400,0		400,0		300,0
Vencimiento de REPO entre el 8 y el 12 de Febrero de 2016	400,0		400,0		0,0
x. Compra con compromiso de Reconquista 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 Expansión el 17 de Enero de 2017	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 8 y el 12 de Febrero de 2016	0,0		0,0		0,0
xi. Compra con compromiso de Reconquista 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 Sustitución el 26 de Mayo de 2017	243,0		243,0		243,0
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 8 y el 12 de Febrero de 2016	0,0		0,0		0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Verbal del BCRP	300,0	600,0	220,0	10	230
Propuestas recibidas	530,0	567,5	255,0	80	250
Plazo de vencimiento	91,4	91,4	91,4	80,4	90,4
Tasas de interés: Mínima	0,74	0,69	0,74	0,72	0,60
Máxima	0,75	0,75	0,74	0,74	0,74
Promedio	0,75	0,75	0,74	0,72	0,64
Saldo	31 306,7	31 226,7	31 286,7	31 076,7	31 076,4
Próximo vencimiento de SC-Verbal el 8 de Febrero de 2016	300,0		450,0		270,0
Vencimiento de SC - Verbal entre el 8 y el 12 de Febrero de 2016	1 195,3		595,3		1 268,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neoposición del BCR	-456,7	-192,2	-17,5	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio	131,0	55,0	5,0		
Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	3 486,1	3 496,6	3 492,6		
ii. Ventas (millones de US\$)					
Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
iii. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
iv. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
v. 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	3 395,3	2 963,6	3 160,5	3 073,1	2 496,5
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (base efectiva diaria)	0,0130%	0,0129%	0,0129%	0,0130%	0,0120%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	16,7%	16,7%	16,7%	16,7%	16,7%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 083,3	2 921,7	3 160,5	3 358,4	2 496,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (Millones de S/)	8 216,3	8 130,0	8 130,0	8 172,8	8 172,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,1	6,0	6,1	6,0	6,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (Millones de S/)	3 083,3	3 083,3	3 109,0	3 056,2	2 925,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,3	2,6	3,1	3,1	2,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	923,0	900,0	1 330,0	779,8	1 002,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,004/0,0/4,00	4,004/0,0/4,00	4,004/0,0/4,00	4,004/0,0/4,00	4,004/0,0/4,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	84,0	105,0	121,0	264,0	264,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP - CDBCRP-NR y CDV	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	29 Enero 16	01 Febrero 16	02 Febrero 16	03 Febrero 16	04 Febrero 16
Flujo de la posición global - a + b + c + e + f + g	121,3	143,9	-95,9	-90,4	-1,3
Flujo de la posición contable - a + b + c + d + e + f + g	-106,2	-35,6	43,5	-120,9	-131,1
a. Mercado spot con el público	-190,3	-225,8	-194,5	-194,5	-165,6
i. Compras	248,0	132,8	164,2	156,6	190,1
ii. (i) Ventas	398,3	358,6	328,7	328,7	342,7
(i) Facturas	18,6	65,3	18,3	31,3	58,6
(ii) Ventas	154,8	145,5	113,4	113,4	262,8
(i) Ventas	136,2	102,2	115,7	62,1	164,2
(ii) Ventas	79,4	137,2	128,8	6,8	-69,4
(i) Ventas	221,5	215,0	197,8	126,6	203,3
(ii) Ventas	142,1	77,8	69,0	121,7	234,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
Al contado	435,0	376,0	400,8	608,5	1003,0
ii. Al futuro	103,0	8,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	123,3	10,0	44,7	118,0	203,8
f. Compras	141,4	76,3	68,7	121,1	231,9
ii. (i) Ventas	18,1	0,0	24,0	68,1	68,1
(ii) Ventas	11,1	6,8	6,8	7,3	8,9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	203,9	369,6	87,2	3,0	-106,9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Igual por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Igual por regulación monetaria en moneda extranjera (Fuente: Databank)					
N) Bases contables	3 470,7	3 485,5	3 493,7	3 491,9	3 475,6