

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	29 Febrero 16	1 Marzo 16	2 Marzo 16	3 Marzo 16	4 Marzo 16
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 670,1	1 650,7	2 585,3	3 569,6	3 573,2
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)	3,0		5,0	5,0	
Propuestas recibidas	85,0		60,0	70,0	
Plazo de vencimiento	192 d		554 d	371 d	
Tasas de Inter Mínima	4,90		5,55	5,30	
Máxima	4,90		5,55	5,30	
Promedio	4,90		5,55	5,30	
Saldo	17 747,0	17 396,1	17 317,3	17 322,3	17 322,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Marzo de 2016					1 635,0
Vencimiento de CD BCRP entre el 7 y el 11 de Marzo de 2016					1 635,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)		1880	1415	1250	1265
Propuestas recibidas		500	500	300	300
Plazo de vencimiento		7 d	1 d	1 d	7 d
Tasas de Inter Mínima		5,93	5,93	5,95	6,04
Máxima		5,93	5,93	5,95	6,04
Promedio		5,93	5,93	5,95	6,04
Saldo		300,0	1 900,0	2 100,0	2 100,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 8 de Marzo de 2016					800,0
Vencimiento de Repo de Valores entre el 7 y el 11 de Marzo de 2016					1 300,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)		200,0	400,0	500,0	500,0
Propuestas recibidas		510,0	1 105,0	852,0	852,0
Plazo de vencimiento		92 d	92 d	92 d	92 d
Tasas de Inter Mínima		5,83	5,80	5,91	5,91
Máxima		5,76	5,80	5,91	5,91
Promedio		5,70	5,80	5,91	5,91
Saldo		1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 26 de Mayo de 2016					400,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 7 y el 11 de Marzo de 2016					0,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 20 mayo de 2016	160,0	160,0	160,0	160,0	160,0
Vencimientos de CDV BCRP entre el 7 y el 11 de Marzo de 2016					160,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	700,0				
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 7 y el 11 de Marzo de 2016	1 070,0				
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 13 Mayo de 2016	2 200,0	2 200,0	2 500,0	2 500,0	2 500,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 7 y el 11 de Marzo de 2016					300,0
vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de Coloc - BN entre el 7 y el 11 de Marzo de 2016					300,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 21 de Marzo de 2016	8 013,8	8 013,8	8 014,0	8 014,0	8 014,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 7 y el 11 de Marzo de 2016					265,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo Regular el 14 de Abril de 2016	14 000,0	14 000,0	14 000,0	14 000,0	14 000,0
Vencimiento de REPO entre el 7 y el 11 de Marzo de 2016					300,0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 7 y el 11 de Marzo de 2016					300,0
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 7 y el 11 de Marzo de 2016					243,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Swap Venta del BCRP	595,0	88,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de Swap Venta del BCRP	595,0	88,0	1 088,6	1 088,6	1 088,6
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Swap Venta del BCRP	31 201,7	30 889,7	30 889,7	30 889,7	29 689,7
Vencimiento de Swap Venta del BCRP					600,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
Tipo de cambio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
Tipo de cambio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
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					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
Saldo					
Próximo vencimiento de SC-Venta el 7 de Marzo de 2016					
Vencimiento de SC - Venta entre el 7 y el 11 de Marzo de 2016					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	684,2	3 250,7	4 080,3	4 564,6	3 769,5
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0128%	0,0128%	0,0128%	0,0128%	0,0128%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	80,0				
Tasa de interés	5,80%		4,80%	4,80%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	163,0	130,0	254,3	268,8	267,7
Tasa de interés	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	601,2	3 120,7	3 826,6	4 295,8	3 481,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 816,0	8 271,9	7 890,9	4 295,8	4 295,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,7	9,2	9,4	8,2	8,2
c. Cuentas corrientes moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	1 753,6	1 637,0	3 120,7	3 473,3	3 475,4
d. Cuentas corrientes moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,6	3,5	3,3	3,4	3,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	770,0	535,0	310,0	449,0	840,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,80/5,20/5,09	5,50/5,55/5,50	5,50/5,55/5,50	5,15/5,20/5,15	4,25/3,0/4,26
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	34,0	15,0	28,0	76,0	106,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,38/0,43/0,39	0,38/0,38/0,38	0,38/0,38/0,38	0,38/0,38/0,38	0,38/0,38/0,38
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	0,0	15,0	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	26 Febrero 16	29 Febrero 16	01 marzo 16	02 marzo 16	03 marzo 16
Flujo de la posición global = a + b - i - c + e + f + g	-2,2	74,2	-148,3	123,3	74,0
Flujo de la posición contable = a + b - i - c + e + g	-46,7	47,5	-83,0	-23,1	-128,0
a. Mercado spot con el público					
i. Compras	45,3	17,6	-101,6	-77,7	-191,3
ii. Compras	228,8	263,8	203,5	224,0	267,5
iii. Compras	275,1	246,0	305,1	301,8	417,2
b. Contratos forward al público (con y sin entrega)					
i. Pactadas	-11,0	-11,0	-65,2	171,7	308,7
ii. Pactadas	59,3	74,2	20,4	265,6	343,3
iii. Vencidas	76,3	85,3	83,9	93,9	34,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)					
i. Pactadas	-48,8	-48,8	-86,3	34,0	15,1
ii. Pactadas	243,1	249,1	177,5	226,9	149,5
iii. Vencidas	291,9	291,9	291,9	192,9	134,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	95,2	496,3	627,0	1093,5	1001,5
ii. A futuro	11,7	4,0	26,3	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	207,8	248,7	206,5	199,7	122,6
i. Compras	230,7	230,7	266,9	172,2	132,6
ii. Compras	22,9	55,6	55,6	12,5	10,0
iii. Compras	-2,7	2,2	7,0	16,7	-2,5
iv. Compras	21,7	-18,6	-103,2	-13,1	-89,6
f. Efecto de Operaciones					
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datarec)	3,5221	3,5240	3,5240	3,5093	3,4611
(*) Dólares preimputados					