

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	30 Julio 15	31 Julio 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1 593,3	1 880,4
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	50,0	
Plazo de vencimiento	133,0	
Tasas de interés: Mínima	3,52	
Máxima	3,54	
Promedio	3,53	
Saldo	15 633,2	15 633,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Agosto de 2015		1 240,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 3 y el 7 de agosto de 2015		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	500,0	170,0
Propuestas recibidas	870,0	170,0
Plazo de vencimiento	7 d	1 d
Tasas de interés: Mínima	4,56	3,30
Máxima	4,56	3,30
Promedio	4,56	3,30
Saldo	3 520,0	4 300,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 3 de Agosto de 2015		1 450,0
Vencimientos de REPO entre el 3 y el 7 de agosto de 2015		2 450,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional		
Propuestas recibidas		
Plazo de vencimiento		
Tasas de interés: Mínima		
Máxima		
Promedio		
Saldo		
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo		
Vencimientos de Depósitos a Plazo entre el 3 y el 7 de agosto de 2015		
iv. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público		
Propuestas recibidas		
Plazo de vencimiento		
Tasas de interés: Mínima		
Máxima		
Promedio		
Saldo	2 199,9	2 199,9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 Noviembre de 2015		300,0
Vencimientos de Coloc-TP entre el 3 y el 7 de agosto de 2015		0,0
v. 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
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016		300,0
Vencimientos de Coloc-BN entre el 3 y el 7 de agosto de 2015		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	155,0	
Propuestas recibidas	205,0	
Plazo de vencimiento	92 d	
Tasas de interés: Mínima	0,50	
Máxima	0,55	
Promedio	0,52	
Saldo	2 497,0	2 497,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 28 de Agosto de 2015		240,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 3 y el 7 de agosto de 2015		0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)		
Propuestas recibidas		500,0
Plazo de vencimiento		1 195,0
Tasas de interés: Mínima		182 d
Máxima		4,51
Promedio		4,61
Saldo	11 800,0	4,60
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de Setiembre de 2015		12 300,0
Vencimientos de REPO entre el 3 y el 7 de agosto de 2015		300,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)		
Propuestas recibidas		
Plazo de vencimiento		
Tasas de interés: Mínima		
Máxima		
Promedio		
Saldo	5 900,0	5 900,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017		300,0
Vencimientos de REPO Expansión entre el 3 y el 7 de agosto de 2015		0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)		
Propuestas recibidas		
Plazo de vencimiento		
Tasas de interés: Mínima		
Máxima		
Promedio		
Saldo	4 304,7	4 304,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017		243,0
Vencimientos de REPO de Sustitución entre el 3 y el 7 de agosto de 2015		0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	140,0	
Propuestas recibidas	140,0	
Plazo de vencimiento	92 d	
Tasas de interés: Mínima	0,55	
Máxima	0,55	
Promedio	0,55	
Saldo	23 929,0	23 929,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de agosto de 2015		250,0
Vencimientos de SC-Venta entre el 3 y el 7 de agosto de 2015		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)		
Tipo de cambio promedio		
ii. Ventas (millones de US\$)		
Tipo de cambio promedio		
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	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
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	2 058,3	3 330,4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones		
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).		
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0110%	0,0100%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)		
Tasa de interés	3,80%	3,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	3,80%	3,80%
Tasa de interés	1 515,8	1 039,5
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,00%	2,00%
Tasa de interés		
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	542,5	2 290,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	6 562,2	6 783,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,8	7,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 869,5	1 883,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP		
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	640,0	283,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,60/4,00/3,97	3,65/3,65/3,65
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	22,0	19,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	20,0	119,0
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\$)	24 Julio 15	30 Julio 15
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f	77,2	-122,5
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f	-202,4	-134,9
a. Mercado spot con el público	-258,3	-368,2
i. Compras	541,1	599,8
ii. (-) Ventas	799,4	968,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	7,4	-153,5
i. Pactadas	108,2	160,6
ii. (-) Vencidas	100,8	314,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-225,2	-122,1
i. Pactadas	322,0	298,6
ii. (-) Vencidas	547,1	420,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias		
i. Al contado	472,5	261,4
ii. A futuro	5,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	507,3	355,2
i. Compras	542,2	400,1
ii. (-) Ventas	34,9	44,9
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	42,0	28,6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera		
Tasa de interés		
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,1891	3,1924