

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

	31 Agosto 15	1 Setiembre 15	2 Setiembre 15	3 Setiembre 15	4 Setiembre 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 320,3	1 435,0	2 886,7	4 263,6	4 434,2
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	50,0		50,0	50,0	
Plazo de vencimiento	192 d		120,0	153,1	
Tasas de interés: Mínima	3,20		554 d	371 d	
Máxima	3,24		3,95	3,58	
Promedio	3,22		4,13	3,62	
Saldo	15 136,2	15 138,2	15 186,2	15 238,2	15 238,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Setiembre de 2015	870,0		870,0		870,0
Vencimiento de CD BCRP entre el 7 y el 11 de setiembre de 2015	0,0		0,0		870,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas		1 000	1 400	600	1 000
Plazo de vencimiento		2 200	2 290	1 600	1 600
Tasas de interés: Mínima		7 d	1 d	7 d	1 d
Máxima		6,30	6,31	6,31	6,31
Promedio		6,30	6,31	6,40	6,31
Saldo	2 400,0	4 800,0	5 000,0	4 500,0	3 450,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 8 de Setiembre de 2015	550,0		1 000,0		1 000,0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 7 y el 11 de setiembre de 2015	0,0		1 550,0		1 600,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 749,9	2 749,9	2 749,9	2 749,9	3 450,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 8 de Setiembre de 2015	300,0		300,0		1 600,0
Vencimiento de Repo de Valores entre el 7 y el 11 de setiembre de 2015	0,0		0,0		300,0
vi. 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	695,5
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016	300,0		300,0		175 d
Vencimiento de Coloc-BN entre el 7 y el 11 de setiembre de 2015	0,0		0,0		6,21
vii. Subasta de Certificados de Depósitos Rescatables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	200,3	300,4	500,6	284,3	91 d
Plazo de vencimiento	91 d	91 d	91 d	91 d	
Tasas de interés: Mínima	0,5	0,50	0,50	0,35	
Máxima	0,5	0,50	0,50	0,35	
Promedio	0,5	0,50	0,50	0,35	
Saldo	6 206,8	6 507,2	7 007,8	7 007,8	7 292,1
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 1 de octubre de 2015	100,0		100,0		100,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 7 y el 11 de setiembre de 2015	0,0		0,0		0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas		300,0	400,0	400,0	200,0
Plazo de vencimiento		1 140	1 160,0	1 160,0	350,0
Tasas de interés: Mínima		731 d	1 100 d	1 099 d	1 099 d
Máxima		5,8	5,9	5,52	5,52
Promedio		6	6,0	6,58	6,58
Saldo	14 200,0	14 250,0	14 650,0	15 050,0	15 250,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de Setiembre de 2015	300		300,0		300,0
Vencimiento de REPO entre el 7 y el 11 de setiembre de 2015	0,0		0,0		0,0
ix. 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	5 900,0	5 900,0	5 900,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 7 y el 11 de setiembre de 2015	0,0		0,0		0,0
x. 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	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 7 y el 11 de setiembre de 2015	0,0		0,0		0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	200,0	500	300	200,0	200,0
Plazo de vencimiento	384,0	926	600	650,0	638,0
Tasas de interés: Mínima	91 d	91 d	91 d	91 d	91 d
Máxima	0,25	0,35	0,40	0,30	0,15
Promedio	0,55	0,55	0,40	0,50	0,19
Saldo	26 046,3	26 346,3	26 351,3	26 351,3	25 951,3
Próximo vencimiento de SC-Venta el 8 de setiembre de 2015	0,0	1 095,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de SC-Venta entre el 7 y el 11 de setiembre de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	600,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
ii. Tipo de cambio promedio					
iii. Ventas (millones de US\$)					
iv. Tipo de cambio promedio					
v. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
vi. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
viii. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
ix. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 270,0	4 135,4	4 836,1	5 113,6	4 934,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0108%	0,0108%	0,0108%	0,0109%	0,0108%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	245,0	35,0			
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
Tasa de interés	708,7	261,2	257,2	245,6	258,3
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%
Tasa de interés	806,3	3 909,2	4 578,9	4 866,0	4 675,9
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	8 407,0	9 407,0	9 904,5	9 056,0	9 191,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	6,7	6,7	6,2	9,8	9,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1 635,1	1 604,1	3 091,5	4 244,1	4 352,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1,7	1,7	3,2	4,5	4,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)					
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 004,0	317,0	394,0	698,0	415,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,25/3,35/3,30	3,30/4,00/3,83	4,00/4,50/4,43	4,75/4,75/4,75	4,50/4,50/4,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	130,5	75,0	66,0	115,0	115,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,150/250,18	0,150/200,16	0,150/200,16	0,150/200,17	0,150/200,16
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	740,0	320,0	2,0	3,0	14,4
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		10,0 / 3,40			
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 Agosto 15	31 Agosto 15	01 Setiembre 15	02 Setiembre 15	03 Setiembre 15
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	-120,1	10,9	-98,4	72,6	70,3
Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + g	-141,7	93,1	-260,5	112,7	-41,8
a. Mercado spot con el público	-270,0	-294,6	-467,1	-79,9	-223,0
i. Compras	271,9	219,5	139,8	239,0	170,6
ii. (i) Ventas	541,9	514,1	746,9	319,0	393,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	18,6	-173,0	63,0	69,6	-65,1
i. Pasadas	120,6	244,5	319,7	124,9	262,3
ii. (i) Vencidas	102,2	417,5	256,8	55,1	327,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-165,5	-162,7	90,1	65,6	-200,6
i. Pasadas	62,5	130,4	214,1	198,9	398,3
ii. (i) Vencidas	228,0	293,1	124,0	133,1	596,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	733,0	452,9	554,5	645,5	861,2
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	193,6	201,5	119,4	122,2	463,6
i. Compras	202,0	290,4	123,3	132,6	589,9
ii. (i) Ventas	8,4	88,9	4,0	10,4	122,2
f. Efecto de Opciones	-64,9	-7,0	101,1	-42,9	-23,4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-37,1	-3,0	182,6	147,2	-12,9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2453	3,2359	3,2452	3,2542	3,2170
(*) Datos preliminares					