

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

(Millones de Nuevos Soles)

	20 Julio 15	21 Julio 15	22 Julio 15	23 Julio 15	24 Julio 15
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>2 885,7</b>	<b>1 752,7</b>	<b>1 784,7</b>	<b>1 633,6</b>	
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	50,0	50,0	50,0	50,1	
Plazo de vencimiento	179,2	140,4	140,4	307,4	
Tasas de interés: Máxima	3,30	3,60	3,60	3,54	
Mínima	3,44	3,80	3,80	3,58	
Promedio	3,38	3,78	3,78	3,55	
Saldo	15 483,1	15 533,1	15 533,1	15 583,2	15 583,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Agosto de 2015	1 240,0	1 240,0	1 240,0	1 240,0	1 240,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 30 v el 31 de julio de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	2 850,0	2 850,0	2 850,0	2 850,0	2 850,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 3 de Agosto de 2015	1 000,0	1 000,0	1 000,0	1 000,0	1 000,0
Vencimientos de REPO entre el 30 v el 31 de julio de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 000,5	400,0	700,0	699,9	
Plazo de vencimiento	1,4	603,5	975,1	975,1	
Tasas de interés: Máxima	2,80	1,4	2,95	2,98	
Mínima	3,14	2,60	3,10	3,08	
Promedio	3,11	2,59	3,04	3,00	
Saldo	1 000,1	400,0	700,0	699,9	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	1 000,1	400,0	700,0	699,9	
Vencimientos de Depósitos a Plazo entre el 30 v el 31 de julio de 2015	1 000,1	400,0	700,0	699,9	
iv. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	1 899,9	1 899,9	1 899,9	1 899,9	1 899,9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 Noviembre de 2015	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimientos de Coloc-TP entre el 30 v el 31 de julio de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Máxima					
Mínima					
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	300,0	300,0
Vencimientos de Coloc-BN entre el 30 v el 31 de julio de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	282,0	282,0	300,0	364,0	
Plazo de vencimiento	51,4	51,4	95,4	95,4	
Tasas de interés: Máxima	0,49	0,49	0,49	0,50	
Mínima	0,55	0,55	0,55	0,55	
Promedio	0,52	0,52	0,53	0,54	
Saldo	2 342,0	2 242,0	2 242,0	2 242,0	2 242,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 30 de Julio de 2015	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimientos de CDR BCRP entre el 30 v el 31 de julio de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resurt)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	11 800,0	11 800,0	11 800,0	11 800,0	11 800,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de Septiembre de 2015	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimientos de Repo Regular entre el 30 v el 31 de julio de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	5 900,0	5 900,0	5 900,0	5 900,0	5 900,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión entre el 30 v el 31 de julio de 2015	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimientos de Repo Expansión entre el 30 v el 31 de julio de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	4 304,7	4 304,7	4 304,7	4 304,7	4 304,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017	243,0	243,0	243,0	243,0	243,0
Vencimientos de Repo Sustitución entre el 30 v el 31 de julio de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swaps Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	60,0	300,0	300	300,0	80,0
Plazo de vencimiento	775,0	700	719	670,0	80,0
Tasas de interés: Máxima	0,40	0,45	0,45	0,40	0,43
Mínima	0,55	0,53	0,50	0,48	0,50
Promedio	0,48	0,50	0,47	0,44	0,45
Saldo	22 989,0	22 989,0	22 989,0	22 989,0	23 789,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de agosto de 2015	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimientos de SC-Venta entre el 30 v el 31 de julio de 2015	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (Millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	-57,4	0,0
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (Millones de US\$)				18,0	
Tipo de cambio promedio				3,1889	
c. Operaciones con el Tesoro Público (Millones de US\$)				0,0	
i. Compras (Millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (Millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR v BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTP					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>1 253,7</b>	<b>1 352,7</b>	<b>1 354,7</b>	<b>997,2</b>	<b>1 033,6</b>
<b>4. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0,0110%	0,0111%	0,0110%	0,0110%	0,0110%
Comisión (base efectiva diaria)					
b. Compra temporal directa de valores (flujo de subasta)					
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	63,2	180,5	238,3	603,7	603,7
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>1 190,5</b>	<b>1 172,2</b>	<b>1 096,4</b>	<b>951,5</b>	<b>729,9</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	7 003,0	7 003,0	6 908,2	6 908,2	6 772,4
Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,3	7,3	7,2	7,2	7,0
b. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 106,8	2 045,7	2 002,6	1 963,1	1 911,7
c. Cuenta corriente moneda extranjera promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,2	2,2	2,1	2,1	2,0
<b>6. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	860,0	701,0	868,0	1 227,0	837,0
Tasas de interés: Máxima / Mínima / Promedio	3,250/2,0/2,25	3,250/3,00/2,25	3,250/3,00/2,25	3,250/3,50/3,36	3,750/3,00/3,82
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Máxima / Mínima / Promedio	0,150/1,50/1,15				0,150/1,50/1,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	48,8	70,0	85,5	12,5	52,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			1,0 / 3,35		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>17 Julio 15</b>	<b>20 Julio 15</b>	<b>21 Julio 15</b>	<b>22 Julio 15</b>	<b>23 Julio 15</b>
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f	-0,9	12,7	15,2	-15,8	224,0
Flujo de la posición contable = a + b + c - d + e + f	-0,2	6,2	-140,1	64,5	71,4
a. Mercado spot con el público	-23,0	-156,3	-156,3	-118,5	-89,2
i. Compras	572,7	508,9	494,4	522,3	596,8
ii. Ventas	595,7	562,2	640,8	640,8	685,0
b. Compras forward al público (con v sin entrega)	34,6	-81,7	-68,8	-68,8	-65,1
i. Placadas	69,7	107,2	41,1	168,6	25,7
ii. Vencidas	35,1	-188,9	-107,9	-218,2	-90,8
c. Ventas forward al público (con v sin entrega)	59,4	55,1	-191,7	215,0	48,9
i. Placadas	217,9	161,4	162,2	301,9	372,6
ii. Vencidas	119,6	126,4	357,9	82,9	323,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	745,5	565,6	571,5	330,3	555,0
ii. A futuro	20,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entrega	108,4	81,7	272,5	81,1	284,6
f. Compras	118,7	123,8	357,6	53,4	322,6
g. Ventas	10,3	42,1	85,0	2,3	37,9
h. Operaciones relacionadas con otras instituciones financieras	61,9	60,6	24,2	184,8	375,6
i. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datacolor)	3,1813	3,1839	3,1807	3,1861	3,1893
<b>v. Datos preliminar</b>					