

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

	14 Setiembre 15	15 Setiembre 15	16 Setiembre 15	17 Setiembre 15	18 Setiembre 15
<i>(Millones de Nuevos Sol)</i>					
1 Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	4 377.5	4 167.8	4 389.9	4 869.7	5 633.2
2 Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	50 160 178.4 3.30 3.30 3.30	300 548 91.4 3.51 4.00 3.85	300.0 567.5 90.4 3.63 4.05 3.98	7.0 37.0 540.4 3.70 3.70 4.02	300.0 591.0 59.4 3.90 4.15 4.01
Máxima					
Promedio					
Saldo	15 788.2	16 068.2	16 075.2	15 346.7	15 646.7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Octubre de 2015	1 078.6		1 078.6		1 005.0
Vencimiento de CD BCRP entre el 21 y el 25 de setiembre de 2015	1 078.6		1 078.6		
i. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 850.0	1 850.0	1 850.0	1 850.0	1 850.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 24 de Setiembre de 2015	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 21 y el 25 de setiembre de 2015	0.0		0.0		0.0
i. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 284.0	2 284.0	2 284.0	2 284.0	2 284.0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 28 de Octubre de 2015	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de Repo Especial BCRP entre el 21 y el 25 de setiembre de 2015	0.0		0.0		0.0
i. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	2 500.0	2 300.0	2 800.0	2 000.0	1 500.1
Plazo de vencimiento	3 093.0	3 218.5	3 488.1	2 000.0	2 279.0
Tasas de interés: Mínima	1.4	1.4	1.4	1.4	3.4
Máxima	2.50	2.80	2.85	3.05	3.00
Promedio	3.20	3.19	3.17	3.50	3.50
Saldo	3.14	3.11	3.10	3.26	3.35
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 21 de setiembre de 2015	2 500.0	2 300.0	2 800.0	3 948.0	3 806.1
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 21 y el 25 de setiembre de 2015	2 500.0		2 800.0		3 606.1
i. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 049.9	3 049.9	3 049.9	3 049.9	3 049.9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 Noviembre de 2015	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 21 y el 25 de setiembre de 2015	0.0		0.0		0.0
i. 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 21 y el 25 de setiembre de 2015	0.0		0.0		0.0
i. Subasta de Certificados de Depósitos Reestructurables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7 292.1	7 292.1	7 292.1	7 292.1	7 292.1
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 1 de octubre de 2015	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 21 y el 25 de setiembre de 2015	0.0		0.0		0.0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Rescolar)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	15 250.0	15 250.0	15 250.0	15 250.0	15 250.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de Setiembre de 2015	200.0		200.0		200.0
Vencimiento de REPO entre el 21 y el 25 de setiembre de 2015	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exanapion)					
Propuestas recibidas	300.0	500.0	300.0	300.0	300.0
Plazo de vencimiento	1 036.0	1 210.0	348.0	1 101.6	51.6
Tasas de interés: Mínima	73.4	9.96	106.4	4.75	5.00
Máxima	5.96	5.50	4.75	5.61	6.26
Promedio	6.41	5.97	5.33	5.90	6.11
Saldo	7 100.0	7 600.0	7 900.0	7 900.0	7 900.0
Próximo vencimiento de Repo Exanapion el 17 de Enero de 2017	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de REPO Exanapion entre el 21 y el 25 de setiembre de 2015	0.0		0.0		0.0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitucion)					
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 Sustitucion el 26 de Mayo de 2017	243.0		243.0		243.0
Vencimiento de REPO Sustitucion entre el 21 y el 25 de setiembre de 2015	0.0		0.0		0.0
xi. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	26 151.3	26 151.3	26 151.3	26 566.3	27 146.3
Próximo vencimiento de SC-Venta el 21 de setiembre de 2015	50.0		50.0		50.0
Vencimiento de SC - Venta entre el 21 y el 25 de setiembre de 2015	0.0		0.0		0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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					
3 Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2 027.5	2 067.6	1 875.9	1 211.6	1 427.1
4 Operaciones monetarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0,0110%	0,0110%	0,0110%	0,0110%	0,0110%
Comisión (base efectiva diaria)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
Tasa de interés	980,0	816,4	816,7	265,4	696,1
Depósitos Overnight en moneda nacional	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%
5 Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 047,5	1 059,2	1 059,2	948,2	771,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (Millones de S/.) (*)	8 213,5	8 188,7	8 188,7	7 750,1	7 607,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,7	8,6	8,4	8,1	8,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (Millones de S/.)	3 244,9	3 121,6	2 992,7	2 878,8	2 758,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (v)	3,6	3,6	3,2	3,1	2,9
6 Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	751,0	134,0	39,0	415,0	56,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,503/203,50	3,303/303,43	3,103/303,15	3,303/303,30	3,303/303,30
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	269,5	156,0	202,0	202,0	328,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,150/200,16	0,150/150,15	0,150/150,15	0,150/150,15	0,150/200,16
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	50,0 / 3,30	131,0	0,0	5,0	50,0 / 3,70
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	11 Setiembre 15	14 Setiembre 15	15 Setiembre 15	16 Setiembre 15	17 Setiembre 15
Flujo de la posición global = a + b + c + e + f + g	-41,9	213,7	196,1	-148,5	67,0
Flujo de la posición contable = a + b + c - d + e + f + g	-51,1	-145,2	101,4	-179,8	48,6
a. Mercado spot con el público	-80,2	282,1	107,4	-247,6	-92,5
i. Compras	228,5	143,3	247,8	192,4	374,0
(i) Ventas	306,7	425,4	354,2	443,0	429,5
ii. Compras forward al público (con y sin entrega)	36,9	164,4	-74,8	102,5	-13,8
i. Paquetadas	173,3	202,2	202,4	121,1	121,1
(i) Vencidas	136,4	334,5	277,0	98,9	138,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	72,3	875,2	-160,4	-15,7	-124,7
i. Paquetadas	236,1	339,9	193,3	163,7	204,9
ii. Vencidas	163,8	349,7	165,4		329,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
Al contado	360,3	511,4	317,0	444,5	347,3
A futuro	5,0	0,0	0,0	5,0	5,0
e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	100,3	717,2	292,8	149,1	297,1
i. Compras	163,1	913,6	348,2	348,2	328,8
(i) Ventas	62,8	196,3	55,6	6,4	28,7
ii. Compras	6,3	51,9	9,1	9,1	8,2
f. Efecto de Decreas	7,2	0,2	-106,6		-83,7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: tipo de operación interbancario promedio (Fuente: Databank)					
N. Efecto de cambio	3,2129	3,2070	3,2080	3,2047	3,1941