BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	12 Octubre 15	13 Octubre 15	14 Octubre 15	15 Octubre 15	16 Octubre 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**4 855,2**	**4 986,6**	**4 111,7**	**4 834,7**	**3 888,5**
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)	50,0 200,0	300,0	4,0 200,0	50,0 200,0	200,0
Prouuestas recibidas	218,0 492,0	600,0	75,0 308,7	200,0 455,0	301,0
Plazo de vencimiento	178 d 94 d	93 d	540 d 92 d	357 d 90 d	89 d
Tasas de interés: Mínima	4,32 4,05	4,09	4,60 4,16	4,35 4,18	4,20
Máxima	4,32 4,20	4,24	4,60 4,30	4,35 4,30	4,32
Promedio	4,32 4,16	4,17	4,60 4,24	4,35 4,22	4,26
Saldo	17 169,0	17 469,0	17 673,0	16 918,0	17 118,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 5 de Noviembre de 2015	1 005,0		1 005,0		375,0
Vencimiento de CD BCRP del 19 al 23 de Octubre de 2015	1 005,0		1 005,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Prouuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	450,0	450,0	450,0	450,0	450,0
Próximo vencimiento de Reoo de Valores el 23 de Diciembre de 2015	150,0		150,0		150,0
Vencimiento de REPO BCRP del 19 al 23 de Octubre de 2015	0,0		0,0		0,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Prouuestas 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 Reoo Esoecial - CDR del 19 al 23 de Octubre de 2015	0,0		0,0		0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	1 000,0 2 200,0	1 500,0 509,0 1 000,0	1385,9 1231	1000,0 2200,0	1000,1 1365,5
Prouuestas recibidas	1 787,0 2 295,0	2 047,8 509,0 1 504,3	1385,9 1231	1093,4 2556,9	1219,0 1365,5
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1d 7d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	3,00 3,10	3,20 3,40 3,20	3,30 3,38	3,40 3,40	3,45 3,30
Máxima	3,42 3,50	3,45 3,50 3,50	3,50 3,50	3,50 3,50	3,50 3,50
Promedio	3.33 3.21	3.40 3.49 3.38	3.46 3.44	3.48 3.44	3.49 3.42
Saldo	3 200,0	3 009,0	3 125,9	3 709,0	2 874,6
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 19 de Octubre de 2015	3 200,0		2 616,9		2 365,6
Vencimiento de Deoósitos a Plazo del 19 al 23 de Octubre de 2015	3 200.0		2 616.9		2 874.6
v. 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 del 19 al 23 de Octubre de 2015	0.0		0.0		0.0
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	600.0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el de 20 Mayo de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Coloc - BN del 19 al 23 de Octubre de 2015	0,0		0,0		0,0
vii. Subasta de Certificados de Deoósitos Reaiustables del BCRP (CDR BCRP)		195.0	68.0		
Propuestas recibidas		195.0	278.0		
Plazo de vencimiento		92 d	92 d		
Tasas de interés: Mínima		0.25	0.60		
Máxima		0,55	0,60		
Promedio		0,43	0,60		
Saldo	7 331.1	7 486.1	7 254.1	6 954.1	6 954.1
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 19 de octubre de 2015	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de CDR BCRP del 19 al 23 de Octubre de 2015	1 188,5		588,5		582,0
viii. Comora con comoromiso de Recomora de moneda extraniera (Reoular)					
Prouuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	16 250.0	16 250.0	16 250.0	16 250.0	16 250.0
Próximo vencimiento de Reoo Reoular el 28 de Octubre de 2015	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de REPO del 19 al 23 de Octubre de 2015	0,0		0,0		0,0
ix. Comora con comoromiso de Recomora de moneda extraniera (Expansión)					
Prouuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0
Próximo vencimiento de Reoo Exoansion el 17 de Enero de 2017	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO Expansión del 19 al 23 de Octubre de 2015	0,0		0,0		0,0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Prouuestas 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 Reoo Sustitucion el 26 de Mavo de 2017	243,0		243,0		243,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 19 al 23 de Octubre de 2015	0,0		0,0		0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			300 300	300,0	300 300
Prouuestas recibidas			609 534	494,0	571 765
Plazo de vencimiento			92 d 92 d	92 d	91 d 95 d
Tasas de interés: Mínima			0,20 0,19	0,39	0,15 0,05
Máxima			0,65 0,68	0,39	0,39 0,34
Promedio			0,44 0,48	0,39	0,30 0,28
Saldo	23 397,4	23 497,5	23 443,5	22 926,5	22 866,4
Próximo vencimiento de SC-Venta el 19 de Octubre de 2015	699,9		817,0		900,0
Vencimiento de SC - Venta del 19 al 23 de Octubre de 2015	2 831,0		1 477,0		3 625,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Comoras (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$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP. CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**1 405,2**	**1 482,6**	**1 222,8**	**1 384,7**	**1 322,9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0109%
b. Comora temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	86,4	55,2	26,6	64,6	198,2
Tasa de interés	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 318,8**	**1 427,4**	**1 196,2**	**1 320,1**	**1 124,7**
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	7 801,1	8 076,3	7 607,1	7 389,1	7 301,7
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,2	8,5	8,0	7,8	7,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 930.2	2 824.0	2 707.7	2 522.1	2 434.8
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,1	3,4	2,8	2,7	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	774.0	983.8	1 087.3	825.0	1 313.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,30/3,50/3,44	3,50/3,50/3,50	3,50/3,60/3,53	3,50/3,50/3,50	3,50/3,55/3,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	137.0	210.0	200.0	186.0	157.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.50/0.50/0.50	0.50/0.55/0.50	0.50/0.55/0.50	0.50/0.75/0.52	0.50/0.55/0.50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	0.0	0,0	0,0	50,0
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$)	**07 Octubre 15**	**12 Octubre 15**	**13 Octubre 15**	**14 Octubre 15**	**15 Octubre 15**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-46,8	81,3	-23,5	-31,8	46,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-58.9	5,1	-161.3	-104.9	37.6
a. Mercado spot con el público	-75.9	-86,2	-195.4	-165.2	-2.5
i. Compras	292,7	271,7	246,7	266,2	267,0
ii. (-) Ventas	368.6	357.9	442.1	431.4	269.5
b. Comoras forward al público (con v sin entrega)	-224.6	8.4	11.4	211.2	112.8
i. Pactadas	122,2	113,5	197,8	362,5	322,0
ii. (-) Vencidas	346,8	105,0	186,4	151,3	209,2
c. Ventas forward al público (con v sin entrega)	-497.1	-34.9	-80.2	140.3	-72.8
i. Pactadas	201,0	48,2	149,3	301,6	101,1
ii. (-) Vencidas	698.2	83.1	229.6	161.3	173.9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	303,0	118,0	254,0	384,6	432,0
ii. A futuro	0.0	0.0	20.0	0.0	0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entrega	450,5	69.9	105.8	141.0	97.9
i. Compras	690.4	82.4	213.0	160.2	170.7
ii. (-) Ventas	239.9	12.4	107.2	19.2	72.8
f. Efecto de Opciones	9.9	32.9	19.0	22.6	-14.3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-352,5	-0,6	-1,4	-91,0	-255,4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2199	3,2286	3,2359	3,2416	3,2347
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera