

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	1 Junio 15	2 Junio 15	3 Junio 15	4 Junio 15	5 Junio 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	3 639,2	4 301,8	4 711,3	4 872,3	5 449,1
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	50,0	50,0
Plazo de vencimiento	279,0	192,7	192,7	207,1	371,4
Tasas de interés: Mínima	3,14	3,20	3,20	3,16	3,16
Máxima	3,21	3,45	3,45	3,16	3,16
Promedio	3,16	3,42	3,42	3,16	3,16
Saldo	14 029,5	14 029,5	14 079,5	14 129,5	14 129,5
Vencimientos de CD BCRP el 11 de Junio de 2015	900,0	900,0	900,0	900,0	900,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 8 y el 12 de Junio de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1 000,0	1 000,0	500,0	500,0	500,0
Plazo de vencimiento	1 060,0	1 060,0	605,0	560,0	512,0
Tasas de interés: Mínima	1,4	1,4	1,4	1,4	1,4
Máxima	3,67	3,31	3,37	3,37	3,33
Promedio	3,71	3,65	3,51	3,37	3,39
Saldo	2 760,0	2 760,0	2 260,0	2 300,0	2 300,0
Vencimientos de Repo el 11 de Junio de 2015	1 000,0	1 000,0	500,0	500,0	500,0
Vencimientos de REPO entre el 8 y el 12 de Junio de 2015	1 460,0	1 460,0	1 460,0	1 460,0	1 460,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de Depósitos a Plazo					
Vencimientos de Depósitos a Plazo entre el 2 y el 5 de Junio de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimientos de Coloc-TP el 27 de Noviembre de 2015					
Vencimientos de Coloc-TP entre el 8 y el 12 de Junio de 2015	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
iv. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas			300,0		
Plazo de vencimiento			775,0		
Tasas de interés: Mínima			368,4		
Máxima			4,31		
Promedio			4,50		
Saldo	300,0	300,0	600,0	600,0	600,0
Vencimientos de Coloc-BN el 20 de Mayo de 2016					
Vencimientos de Coloc-BN entre el 8 y el 12 de Junio de 2015	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
v. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimientos de CDR BCRP el 7 de Julio de 2015					
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 8 y el 12 de Junio de 2015	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas	500,0	1 185,0	185,4	0,0	0,0
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 500,0	11 500,0	11 500,0	11 500,0	11 500,0
Vencimientos de Repo Regular el 21 de Setiembre de 2015					
Vencimientos de REPO entre el 8 y el 12 de Junio de 2015	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 500,0	4 500,0	4 500,0	4 500,0	4 900,0
Vencimientos de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017					
Vencimientos de REPO entre el 8 y el 12 de Junio de 2015	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas			300,0		
Plazo de vencimiento			500,0		
Tasas de interés: Mínima			730,4		
Máxima			3,05		
Promedio			3,03		
Saldo	3 473,0	3 473,0	3 773,0	3 773,0	3 773,0
Vencimientos de Repo Sustitución el 2 de Junio de 2017					
Vencimientos de REPO entre el 8 y el 12 de Junio de 2015	200,0	295,0	200,0	0,0	0,0
ix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	300,0	425,0	92,4	0,0	0,0
Plazo de vencimiento			0,09		
Tasas de interés: Mínima			0,20		
Máxima			0,14		
Promedio			0,18		
Saldo	24 613,0	24 608,0	24 608,0	24 608,0	24 308,0
Vencimientos de SC-Venta el 8 de Junio de 2015					
Vencimientos de SC-Venta entre el 8 y el 12 de Junio de 2015	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
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\$)					
Comisión (tasa efectiva diaria)					
Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés					
Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés					
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	5 089,2	5 301,8	5 461,3	5 822,3	5 849,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0111%	0,0111%	0,0112%	0,0112%	0,0110%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
c. Depósitos Overnight en moneda nacional	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
Tasa de interés	450,0	447,7	450,1	448,2	2 784,0
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4 639,2	4 854,1	5 011,2	4 474,1	3 065,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	7 113,1	8 648,4	9 187,2	9 448,2	9 371,6
b. Fondos de encaje en moneda extranjera promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,5	9,6	10,0	9,9	9,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 935,0	3 294,6	4 746,6	4 678,5	4 489,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	3,8	4,3	4,9	4,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,35/3,60/3,51	3,40/3,50/3,50	3,50/3,55/3,50	3,25/3,35/3,44	3,25/3,35/3,33
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	19,0	118,0	108,0	155,0	108,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,150/150,15	0,150/150,15	0,150/150,15	0,150/150,15	0,150/150,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	11,1	50,0	163,0	113,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			50,0 / 3,15	50,0 / 3,15	50,0 / 3,15
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	29 Mayo 15	01 Junio 15	02 Junio 15	03 Junio 15	04 Junio 15
Flujo de la posición global = a + b) - c) + e + f	92,2	-56,7	-49,8	-152,1	-111,1
Flujo de la posición contable = a + b) - c) + e + f	185,5	-7,7	-62,9	-270,0	-119,3
a. Mercado spot con el público	-93,1	-99,7	-171,2	-503,3	-189,7
i. Compras	324,4	357,6	212,7	233,3	464,9
ii. Ventas	417,5	457,3	383,9	736,6	654,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	29,1	-71,8	-26,4	-67,4	61,2
i. Placadas	325,7	176,6	185,6	227,2	202,3
ii. Vencidas	296,7	248,5	212,0	294,5	141,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	56,3	-56,4	-43,1	-185,3	-169,2
i. Placadas	303,8	193,9	218,5	318,7	241,3
ii. Vencidas	247,5	250,3	261,6	503,9	410,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	902,7	605,2	848,5	1181,0	912,6
ii. A futuro	40,0	0,0	0,0	0,0	20,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	156,7	94,7	157,8	354,4	350,5
i. Compras	245,7	248,3	250,2	485,4	409,2
ii. Ventas	89,0	153,6	92,4	131,1	58,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	6,6	-34,5	-3,5	88,4	-10,7
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,1571	3,1572	3,1566	3,1525	3,1455
(*) Datos preliminares					