

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	8 Junio 15	9 Junio 15	10 Junio 15	11 Junio 15	12 Junio 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5 822,6	5 763,9	5 424,6	5 528,9	5 260,3
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	200	200,0	50,0	200,0
Plazo de vencimiento	238	587,2	787,2	267,1	567,1
Tasas de interés: Mínima	185 d	185 d	366 d	366 d	182 d
Máxima	2,58	3,15	3,20	3,16	2,40
Promedio	3,16	3,24	3,25	3,25	3,16
Saldo	14 379,5		14 829,5	14 179,5	14 379,5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 9 de Julio de 2015	900,0		900,0		1 800,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 15 y el 19 de Junio de 2015	900,0		900,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 800,0	1 800,0	1 800,0	1 800,0	1 800,0
Próximo vencimiento de Repo el 23 de Junio de 2015	500,0		500,0		300,0
Vencimientos de REPO entre el 15 y el 19 de Junio de 2015	500,0		500,0		0,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 300,0	1 500,0	2 000,0	1 600,0	2 000,0
Plazo de vencimiento	3 173,1	3 194,2	2 986,9	3 019,2	3 117,7
Tasas de interés: Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	2,20	2,05	2,05	2,03	2,02
Promedio	2,29	2,19	2,12	2,08	2,10
Saldo	1 300,0	1 500,0	2 000,0	1 600,0	2 000,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 15 de Junio de 2015	1 300,0		2 000,0		2 000,0
Vencimientos de Depósitos a Plazo entre el 15 y el 19 de Junio de 2015	1 300,0		2 000,0		2 000,0
iv. 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	900,0	900,0	900,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 Noviembre de 2015	300,0		300,0		300,0
Vencimientos de Coloc-TP entre el 15 y el 19 de Junio de 2015	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: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 de Mayo de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimientos de Coloc-BN entre el 15 y el 19 de Junio de 2015	0,0		0,0		0,0
vi. 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
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 7 de Julio de 2015	300,0		300,0		300,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 15 y el 19 de Junio de 2015	0,0		0,0		0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
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
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de Setiembre de 2015	300,0		300,0		300,0
Vencimientos de REPO entre el 15 y el 19 de Junio de 2015	0,0		0,0		200,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 900,0	4 900,0	4 900,0	4 900,0	5 100,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017	300,0		300,0		300,0
Vencimientos de REPO entre el 15 y el 19 de Junio de 2015	0,0		0,0		0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 773,0	3 773,0	3 773,0	3 773,0	3 973,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017	243,0		243,0		243,0
Vencimientos de REPO entre el 15 y el 19 de Junio de 2015	0,0		0,0		0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	650,0	650,0	650,0	650,0	650,0
Plazo de vencimiento	92 d	92 d	92 d	92 d	92 d
Tasas de interés: Mínima	0,00	0,00	-0,11	0,00	0,00
Máxima	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Promedio	0,00	0,00	-0,07	0,00	0,00
Saldo	24 008,0	23 408,0	22 808,0	21 908,0	21 008,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 15 de Junio de 2015	600,0		600,0		600,0
Vencimientos de SC-Venta entre el 15 y el 19 de Junio de 2015	3 300,0		1 800,0		3 000,0
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)					
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					
Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	4 272,6	4 063,9	3 474,6	3 678,9	3 460,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0111%	0,0112%	0,0111%	0,0111%	0,0101%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	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	2 455,3	2 673,8	3 072,9	1 907,0	2 116,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	8 950,5	9 159,9	8 716,2	8 473,8	8 355,4
b. Fondos de encaje en moneda extranjera promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,4	9,6	9,2	8,9	8,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	4 038,6	3 945,9	3 766,8	3 537,3	3 418,9
d. Cuenta corriente moneda extranjera promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,3	4,5	4,0	3,7	3,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	704,9	1 144,0	774,0	866,0	825,0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	3,25/3,25/3,25	3,20/3,25/3,25	3,25/3,25/3,25	3,25/3,25/3,25	3,25/3,25/3,25
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	108,0	218,0	215,0	238,0	166,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	13,3	75,0	100,0	40,0	250,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		75,0 / 3,15	70,0 / 3,15		200,0 / 3,15
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	05 Junio 15	08 Junio 15	09 Junio 15	10 Junio 15	11 Junio 15
Flujo de la posición global = a + b) - c) + e + f	41,6	-76,3	17,5	56,7	-12,8
Flujo de la posición contable = a + b) - c) + e + f	60,9	20,5	148,4	123,9	-152,6
a. Mercado spot con el público	7,9	-31,5	122,8	-63,6	-231,2
i. Compras	422,2	372,2	310,1	317,5	233,1
ii. Ventas	414,2	403,7	187,3	381,2	464,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	64,4	9,5	42,2	58,6	-178,3
i. Pacladas	208,7	105,7	206,3	295,1	205,4
ii. Vencidas	144,2	96,2	164,1	236,5	383,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-24,3	7,6	-25,1	-69,2	-608,2
i. Pacladas	184,1	163,4	219,2	170,0	386,7
ii. Vencidas	209,5	155,8	244,4	239,2	994,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	616,8	689,6	831,0	860,5	732,1
ii. A futuro	20,0	0,0	33,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	115,7	111,4	105,6	190,3	702,8
i. Compras	206,2	152,7	244,2	226,4	993,1
ii. Ventas	90,4	41,3	138,6	36,1	290,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-106,5	-98,6	-198,0	-195,0	-303,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,1530	3,1535	3,1529	3,1545	3,1544
(*) Datos preliminares					