BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	22 Junio 15	23 Junio 15	24 Junio 15	25 Junio 15	26 Junio 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	**2 186,8**	**949,9**	**353,3**	**858,3**	**410,3**
2. Ooeraciones monetarias v cambiarias del BCR antes del cierre de ooeraciones					
a. Ooeraciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	50,0 200,0 200,0		45,0	50,0	
Propuestas recibidas	170,3 238,2 377,2		96,8	57,7	
Plazo de vencimiento	178 d 87 d 178 d		540 d	350 d	
Tasas de interés: Mínima	3,35 3,29 3,50		3,49	3,45	
Máxima	3,49 3,49 3,72		3,80	3,80	
Promedio	3,49 3,44 3,66		3,76	3,71	
Saldo	16 488,1	16 488,1	16 533,1	16 583,1	16 583,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 9 de Julio de 2015		1 800,0		1 800,0	1 800,0
Vencimientos de CD BCRP del 30 de Junio al 3 de iulio de 2015		0.0		0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			300,0	300,0 150,0	1 200,0 500,0
Propuestas recibidas			980,0	1 140,0 150,0	3 190,0 990,0
Plazo de vencimiento			92 d	92 d 181 d	7 d 91 d
Tasas de interés: Mínima			3,95	4,35 4,00	4,12 4,21
Máxima			4,20	4,61 4,81	5,15 4,46
Promedio			4,01	4,45 4,52	4,44 4,37
Saldo		1 000,0	800,0	1 250,0	2 450,0
Próximo vencimiento de Repo el 24 de Setiembre de 2015		500,0		500,0	300,0
Vencimientos de REPO del 30 de Junio al 3 de iulio de 2015		1 000.0		500.0	0.0
iii. Subasta de Deoósitos a Plazo en Moneda Nacional	376,0 252,8				
Propuestas recibidas	381,0 254,0				
Plazo de vencimiento	1 d 1 d				
Tasas de interés: Mínima	3,29 3,50				
Máxima	3,49 3,72				
Promedio	3,44 3,66				
Saldo	628.8	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Deoósitos a Plazo					
Vencimientos de Depósitos a Plazo del 30 de Junio al 3 de julio de 2015		0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público			499,9		
Propuestas recibidas			1 687,9		
Plazo de vencimiento			177 d		
Tasas de interés: Mínima			4,35		
Máxima			4,90		
Promedio			4,47		
Saldo	900,0	900,0	1 399,9	1 399,9	1 399,9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 Noviembre de 2015		300,0		300,0	300,0
Vencimientos de Coloc-TP del 30 de Junio al 3 de julio 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 de 20 Mavo de 2016		300,0		300,0	300,0
Vencimientos de Coloc-BN del 30 de Junio al 3 de julio de 2015		0,0		0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	240,0				
Propuestas recibidas	240,0				
Plazo de vencimiento	67 d				
Tasas de interés: Mínima	0.08				
Máxima	0,20				
Promedio	0.15				
Saldo	840.0	840.0	840.0	840.0	840.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 7 de Julio de 2015		300,0		300,0	300,0
Vencimientos de Deoósitos Reajustables del 30 de Junio al 3 de iulio 2015		0.0		0.0	0.0
vii. Comora con compromiso de Recomora de moneda extraniera (Reoular)					
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 del 30 de Junio al 3 de julio de 2015		0,0		0,0	0,0
viii. Comora con compromiso de Recomora de moneda extraniera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 100,0	5 100,0	5 100,0	5 100,0	5 100,0
Próximo vencimiento de Reoo Expansion el 17 de Enero de 2017		300,0		300,0	300,0
Vencimientos de REPO del 30 de Junio al 3 de julio 2015		0,0		0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)	200,0				131,7
Propuestas recibidas	263,3				331,7
Plazo de vencimiento	728d				728 d
Tasas de interés: Mínima	3,10				3,11
Máxima	3,28				3,25
Promedio	3,19				3,16
Saldo	4 173,0	4 173,0	4 173,0	4 173,0	4 304,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 26 de Mayo de 2017		243,0		243,0	243,0
Vencimientos de REPO del 30 de Junio al 3 de julio 2015		0,0		0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	151,0 210,0 150,0	300,0 406,0 50,0	260,0 450,0 280,0 150,0	464,0 350,0 600,0	600,0 60,0 150,0
Propuestas recibidas	301,0 260,0 200,0	667,0 1 000,0 250,0	260,0 700,0 480,0 350,0	600,0 600,0 600,0	600,0 60,0 150,0
Plazo de vencimiento	65 d 91 d 66 d	91 d 92 d 93 d	92 d 62 d 93 d 96 d	92 d 95 d 96 d	87 d 88 d 88 d
Tasas de interés: Mínima	0,04 0,17 0,20	0,15 0,20 0,20	0,55 0,55 0,55 0,55	0,49 0,55 0,49	0,49 0,55 0,55
Máxima	0,20 0,20 0,20	0,20 0,20 0,20	0,36 0,55 0,55 0,55	0,55 0,55 0,55	0,55 0,55 0,55
Promedio	0,09 0,19 0,20	0,19 0,20 0,20	0,20 0,55 0,55 0,55	0,53 0,55 0,51	0,54 0,55 0,55
Saldo	21 450,1	21 606,1	22 146,1	22 960,1	23 170,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de Junio de 2015		600,0		600,0	900,0
Vencimientos de SC-Venta del 30 de Junio al 3 de iulio 2015		1 800,0		600,0	2 700,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-253,9	-397,4	-263,6	-31,7	-31,7
i. Comoras (millones de US$)					
Tipo de cambio oromedio					
ii. Ventas (millones de US$)	80,0	125,0	83,0	10,0	10,0
Tipo de cambio oromedio	3.1732	3.1794	3.1757	3.1677	3.1720
c. Ooeraciones con el Tesoro Público (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Comoras (millones de US$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público					
d. Ooeraciones en el Mercado Secundario de CD BCRP. CD BCRP-NR v BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**614,2**	**552,5**	**844,7**	**1 226,6**	**2 078,6**
4. Ooeraciones monetarias del BCR oara el cierre de ooeraciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0111%	0,0111%	0,0111%	0,0111%	0,0107%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)		486,2	315,0		
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	3.80%	3.80%	3.80%	3.80%	3.80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	149,0	146,3	147,9	1 063,9
Tasa de interés	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**614,2**	**889,7**	**1 013,4**	**1 078,7**	**1 014,7**
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	7 718,1	7 535,1	7 718,1	7 170,0	7 153,3
b Fondos de encaie en moneda nacional oromedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,1	7.9	8.1	7.6	7.5
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 723,3	2 643,6	2 370,7	2 319,0	2 264.1
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,0	2,8	3,0	2,4	2,4
6. Mercado interbancario v mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 264,0	974,5	1 240,0	911,5	664,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,25/3,35/3,26	3,40/3,70/3,60	3,60 / 3,75 / 3,68	3,60 / 3,85 / 3,75	3,80 / 4,05 / 3,86
b. Ooeraciones a la vista en moneda extraniera (millones de US$)	98.0	42.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.15/0.15/0.15	0.15/0.15/0.15			
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	43,6	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa oromedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	43.6 / 3.23				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**19 Junio 15**	**22 Junio 15**	**23 Junio 15**	**24 Junio 15**	**25 Junio 15**
Fluio de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-87,0	101,6	-129,1	26,5	134,5
Fluio de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	172,8	188,4	-177,3	91,9	-178,9
a. Mercado spot con el público	-66,8	8,6	-310,5	-103,9	-275,6
i. Compras	464,2	491,4	461,3	551,4	341,2
ii. (-) Ventas	530,9	482,7	771,9	655,3	616,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	0,8	18,3	86,1	-80,7	-169,7
i. Pactadas	207,3	70,5	183,8	162,4	87,8
ii. (-) Vencidas	206,5	52,2	97,7	243,1	257,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	323,0	74,2	83,4	151,6	-228,7
i. Pactadas	599,0	166,8	291,9	392,1	363,5
ii. (-) Vencidas	276,0	92,6	208,6	240,6	592,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	954,2	699,9	968,0	852,6	781,0
ii. A futuro	40.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	138.6	59.6	136.2	125.8	430.2
i. Compras	275,0	91,5	208,2	194,0	584,1
ii. (-) Ventas	136.5	31,9	72,0	68.3	153.9
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	232.9	129.6	153.4	234.4	255.6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,1678	3,1743	3,1793	3,1762	3,1679

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera