

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

	30 Junio 15	01 Julio 15	02 Julio 15	03 Julio 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1 852,2	1 270,5	2 245,8	1 246,3
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				
Plazo de vencimiento	181,0	50,0	50,0	50,0
Tasas de interés: Mínima	3,50	3,75 d	3,75 d	3,75 d
Máxima	3,91	3,91	3,72	3,72
Promedio	3,81	3,81	3,72	3,72
Saldo	16 583,1	16 633,1	16 633,1	16 683,1
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 6 al 10 de Julio de 2015		0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas	181,0	300,0	500,0	1 000,0
Plazo de vencimiento	1 d	187 d	1 d	1 d
Tasas de interés: Mínima	3,25	4,22	3,53	3,28
Máxima	4,50	4,51	3,90	3,61
Promedio	3,95	4,23	3,89	3,46
Saldo	2 631,0	4 621,0	5 050,0	4 350,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 6 de Julio de 2015	1 200,0	871,0	2 500,0	1 800,0
Vencimientos de REPO del 6 al 10 de Julio de 2015	0,0	2 071,0	2 500,0	1 800,0
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
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de Depósitos a Plazo del 6 al 10 de Julio de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	1 399,9	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 6 al 10 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
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016		300,0	300,0	300,0
Vencimientos de Coloc-BN del 6 al 10 de Julio de 2015		0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas		100,0	260,0	260,0
Plazo de vencimiento		93 d	93 d	93 d
Tasas de interés: Mínima		0,55	0,55	0,55
Máxima		0,55	0,55	0,55
Promedio		0,55	0,55	0,55
Saldo	1 140,0	1 500,0	1 500,0	1 500,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 7 de Julio de 2015		300,0	300,0	300,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables del 6 al 10 de Julio 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
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de Setiembre de 2015		300,0	300,0	300,0
Vencimientos de REPO del 6 al 10 de Julio de 2015		0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	5 100,0	5 100,0	5 100,0	5 600,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017		300,0	300,0	300,0
Vencimientos de REPO Expansión del 6 al 10 de Julio 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	4 304,7	4 304,7	4 304,7	4 304,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017	243,0	243,0	243,0	243,0
Vencimientos de REPO de Sustitución del 6 al 10 de Julio de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	437,0	100,0	70,0	250,0
Propuestas recibidas	587,0	300,0	210,0	510,0
Plazo de vencimiento	92 d	93 d	93 d	93 d
Tasas de interés: Mínima	0,49	0,55	0,55	0,55
Máxima	0,55	0,55	0,55	0,55
Promedio	0,54	0,55	0,55	0,55
Saldo	23 127,1	22 967,1	22 967,1	22 967,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 6 de Julio de 2015		600,0	600,0	700,0
Vencimientos de SC-Venta del 6 al 10 de Julio de 2015		1 200,0	1 200,0	3 845,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)	-365,6	-31,8	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)	115,0	10,0		
iii. Tipo de cambio promedio	3,1791	3,1818		
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	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
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	1 367,6	3 000,4	3 495,8	3 546,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Tasa de interés	0,0111%	0,0111%	0,0111%	0,0100%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	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	1 002,6	2 868,5	3 380,6	3 433,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) ⁽¹⁾	7 718,1	7 790,3	7 686,1	7 803,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) ⁽¹⁾	92,4	93,4	95,4	95,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 216,6	2 868,5	2 718,3	3 056,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) ⁽¹⁾	3,0	3,5	3,5	3,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,70 / 3,80 / 3,80	3,80 / 3,90 / 3,84	3,50 / 3,50 / 3,50	3,25 / 3,25 / 3,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	23,0	39,0	97,0	84,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15 / 0,15 / 0,15	0,15 / 0,15 / 0,15	0,15 / 0,15 / 0,15	0,15 / 0,15 / 0,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV				
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\$)	26 Junio 15	30 Junio 15	01 Julio 15	02 Julio 15
Flujo de la posición oficial = a + b - c + e + f	23,6	87,0	-62,5	-62,2
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f	-1,6	311,2	-78,9	-111,8
a. Mercado spot con el público	-164,7	-204,9	-366,3	-191,1
i. Compras	472,8	452,9	331,4	404,8
ii. (-) Ventas	637,5	660,8	697,6	595,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-140,0	-206,6	-27,3	-30,1
i. Pacladas	135,6	239,5	229,9	72,7
ii. (-) Vencidas	275,5	446,1	256,1	102,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-89,6	-1,9	-86,8	-81,7
i. Pacladas	199,0	366,3	289,9	362,2
ii. (-) Vencidas	297,6	368,3	388,7	443,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	364,2	440,8	511,1	261,0
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forward sin entrega	139,5	233,0	302,8	433,3
i. Compras	245,9	365,2	365,2	443,6
ii. (-) Ventas	106,4	123,1	62,3	10,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	109,1	185,6	61,9	-14,9
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)				
(1) Datos preliminares	3,1713	3,1785	3,1805	3,1716