

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	13 Julio 15	14 Julio 15	15 Julio 15	16 Julio 15	17 Julio 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	3 872,2	3 791,4	3 681,1	3 688,2	2 215,8
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	200,0 200,0	50,0 200,0	50 200	
Propuestas recibidas	323,4 461,1	327,2 557,1	108,0 155,1	155,1 494,2	
Plazo de vencimiento	186 d 367 d	288 d 184 d	547 d 547 d	364 d 286 d	
Tasas de interés: Mínima	3,35 3,42	3,50 3,39	3,59 3,49	2,73 3,49	
Máxima	3,50 3,65	3,58 3,49	3,75 3,60	3,60 3,50	
Promedio	3,48 3,53	3,57 3,48	3,72 3,53	3,53 3,50	
Saldo	15 383,1 650,0	15 783,1 650,0	15 633,1 650,0	15 433,1 650,0	15 433,1 1 240,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Agosto de 2015					
Vencimientos de CD BCRP entre el 20 y el 24 de julio de 2015					
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 850,0 1 000,0	2 850,0 1 000,0	2 850,0 1 000,0	2 850,0 1 000,0	2 850,0 1 000,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 3 de Agosto de 2015					
Vencimientos de REPO entre el 20 y el 24 de julio de 2015					
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 965,5 1 152,0	1 964,4 1 152,0	1 300,0 1 489,5	1 300,0 1 152,0	1 152,0 1 152,0
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d
Tasas de interés: Mínima	2,65 2,65	2,65 2,79	2,65 2,80	2,65 2,80	2,65 2,80
Máxima	3,00 3,00	3,02 2,96	3,00 2,96	3,00 2,96	3,00 2,96
Promedio	2,89 2,94	2,89 2,96	2,96 2,96	2,96 2,96	2,96 2,96
Saldo	1 200,0 1 200,0	1 600,0 1 600,0	1 300,0 1 200,1	1 200,1 1 200,1	1 152,0 1 152,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 20 de Julio de 2015					
Vencimientos de Depósitos a Plazo entre el 20 y el 24 de julio de 2015					
iv. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 899,9 300,0	1 899,9 300,0	1 899,9 300,0	1 899,9 300,0	1 899,9 300,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 Noviembre de 2015					
Vencimientos de Coloc-TP entre el 20 y el 24 de julio de 2015					
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	600,0 300,0	600,0 300,0	600,0 300,0	600,0 300,0	600,0 300,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 de Mayo de 2016					
Vencimientos de Coloc-BN entre el 20 y el 24 de julio de 2015					
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Arajauasiales del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 760,0 100,0	1 760,0 100,0	2 060,0 100,0	2 060,0 100,0	2 060,0 100,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 20 de Julio de 2015					
Vencimientos de CDR BCRP entre el 20 y el 24 de julio de 2015					
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resurt)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 500,0 300,0	11 500,0 300,0	11 500,0 300,0	11 500,0 300,0	11 800,0 300,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de Septiembre de 2015					
Vencimientos de Repo entre el 20 y el 24 de julio de 2015					
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 900,0 300,0	5 900,0 300,0	5 900,0 300,0	5 900,0 300,0	5 900,0 300,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 20 y el 24 de julio de 2015					
Vencimientos de Repo Expansión entre el 20 y el 24 de julio de 2015					
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 304,7 243,0	4 304,7 243,0	4 304,7 243,0	4 304,7 243,0	4 304,7 243,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017					
Vencimientos de Repo Sustitución el 20 y el 24 de julio de 2015					
x. Subasta de Swaps Cambiario/Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	22 021,9 600,0	22 022,0 600,0	21 864,0 300,0	21 864,0 300,0	22 089,0 600,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 20 de julio de 2015					
Vencimientos de SC-Venta entre el 20 y el 24 de julio de 2015					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (Millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
Ventas (Millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (Millones de US\$)					
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					
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	2 122,2	1 791,4	1 388,1	1 688,1	1 361,8
4. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (base efectiva diaria)	0,0111%	0,0111%	0,0110%	0,0111%	0,0100%
b. Compra temporal directa de valores (flujos 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	6,70%	9,80%	2,30%	2,66%	3,00%
Tipo de cambio	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	1 446,2	1 693,4	1 197,8	1 394,4	1 061,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	7 417,4	7 676,2	7 316,1	7 311,9	7 191,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,8	7,9	7,6	7,5	7,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 734,7	2 660,3	2 427,9	2 363,1	2 267,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,9	2,8	2,6	2,6	2,5
6. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,25 / 3,25 / 3,25	3,013/25,0/19	633,0	3,25/3,25/25	691,0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (Millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	17,0	108,9	89,8	51,5	22,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		20,0 / 3,48			1.550 / 150,15
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		15,0 / 3,55			43,0
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (Millones de US\$)	10 Julio 15	13 Julio 15	14 Julio 15	15 Julio 15	15 Julio 15
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f	-97,2	-118,3	-35,4	203,5	203,5
Flujo de la posición contable = a + b + c - d + e + f	163,7	-217,7	54,8	121,8	121,8
a. Mercado spot con el público	113,9	-288,7	-16,9	-73,8	-73,8
i. Compras	600,3	625,9	665,1	668,6	668,6
ii. Ventas	486,4	794,6	578,0	642,4	642,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-102,4	91,1	-36,4	110,0	110,0
i. Pactadas	41,0	269,6	110,8	233,8	233,8
ii. (f) Vencidas	-143,4	178,5	147,2	123,8	123,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-32,9	-198,8	52,3	5,8	5,8
i. Pactadas	254,9	260,9	296,9	492,2	492,2
ii. (f) Vencidas	317,8	559,7	234,6	396,5	396,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	203,9	502,8	431,0	631,3	631,3
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	20,0	20,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	243,0	452,1	158,9	374,9	374,9
f. Compras	287,1	548,8	168,8	376,7	376,7
g. (f) Ventas	44,1	92,7	9,7	2,9	2,9
h. Operaciones spot con otras instituciones financieras	-210,2	-190,4	-1,3	71,9	71,9
i. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Note: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datacol)	3,1778	3,1779	3,1780	3,1819	3,1819