BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	3 Agosto 15	4 Agosto 15	5 Agosto 15	06 Agosto 15	07 Agosto 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	**2 610,0**	**3 343,7**	**3 575,9**	**2 957,9**	**2 070,4**
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	
Plazo de vencimiento	244,7		124,0	232,5	
Tasas de interés: Mínima	192 d		554 d	371 d	
Máxima	3,29		3,60	3,45	
Promedio	3,32		3,89	3,51	
Saldo	3,31		3,82	3,48	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Agosto de 2015	15 683,2	15 683,2	15 733,2	15 783,2	15 783,2
Vencimiento de CD BCRP entre el 10 y el 14 de agosto de 2015		1 240,0	1 240,0		1 240,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)		0,0	0,0		1 240,0
Propuestas recibidas	500,0 500,0	500,0		300,0	
Plazo de vencimiento	1 155,0 1 435,0	875,0		480,0	
Tasas de interés: Mínima	1 d 7 d	1 d		1 d	
Máxima	3,51 3,76	3,51		3,91	
Promedio	3,60 4,61	3,80		3,91	
Saldo	3,52 4,21	3,61		3,91	
Próximo vencimiento de Reno de Valores el 10 de Agosto de 2015	3 850,0	3 850,0	3 350,0	3 150,0	2 350,0
Vencimiento de REPO entre el 10 y el 14 de agosto de 2015		500,0	500,0		500,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional		1 500,0	1 000,0		500,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo					
Vencimientos de Depósitos a Plazo entre el 10 v el 14 de agosto 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	2 199.9	2 199.9	2 199.9	2 199.9	2 199.9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 Noviembre de 2015		300,0	300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP el 10 y el 14 de agosto de 2015		0,0	0,0		0,0
v. Subasta de Colocacion DP en M.N. del Banco de la Nacion					
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 Mayo de 2016		300,0	300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-BN entre el 10 v el 14 de agosto de 2015		0,0	0,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Deoósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			300 265	300,0	
Propuestas recibidas			450 265	315,0	
Plazo de vencimiento			92 d 92 d	92 d	
Tasas de interés: Mínima			0.45 0.15	0.55	
Máxima			0.55 0.50	0.55	
Promedio			0,48 0,29	0,55	
Saldo	2 497.0	2 497.0	3 062.0	3 362.0	3 362.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 28 de Agosto de 2015		240.0	240.0		240.0
Vencimiento de Depósitos Reajustables entre el 10 y el 14 de agosto de 2015		0,0	0,0		0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					400,0
Propuestas recibidas					790,0
Plazo de vencimiento					182 d
Tasas de interés: Mínima					4,96
Máxima					5.15
Promedio					5.07
Saldo	12 300,0	12 300,0	12 300,0	12 300,0	12 700,0
Próximo vencimiento de Reno Regular el 21 de Setiembre de 2015		300,0	300,0		300,0
Vencimiento de REPO entre el 10 v el 14 de agosto 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	5 900.0	5 900.0	5 900.0	5 900.0	5 900.0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el 17 de Enero de 2017		300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 10 y el 14 de agosto de 2015		0,0	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	4 304.7
Próximo vencimiento de Reno Sustitucion el 26 de Mayo de 2017		243,0	243,0		243,0
Vencimiento de REPO de Sustitución entre el 10 y el 14 de agosto de 2015		0.0	0,0		0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300,0	100,0	200 50	80,0	160,0
Propuestas recibidas	300.0	100.0	300 50	140.0	160.0
Plazo de vencimiento	92 d	92 d	92 d 92 d	92 d	94 d
Tasas de interés: Mínima	0,45	0,55	0,54 0,52	0,49	0,50
Máxima	0,55	0,55	0,55 0,52	0,49	0,55
Promedio	0.50	0.55	0.55 0.52	0.49	0.52
Saldo	24 229.0	24 329.0	24 579.0	24 659.0	24 819.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de agosto de 2015		250,0	250,0		250,0
Vencimiento de SC-Venta entre el 10 v el 14 de agosto de 2015		0.0	0.0		0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-137.4	0.0	-461.2	-243.5	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	43.0		144.0	76.0	
Tipo de cambio promedio	3.1950		3.2030	3.2040	
c. Operaciones 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$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Comoras de CD BCRP v CD BCRP-NR					
ii. Comoras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3 422,6**	**3 843,7**	**2 499,7**	**2 664,4**	**2 470,4**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0110%	0.0110%	0.0110%	0.0110%	0.0100%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			325,0		130,0
Tasa de interés	3.80%	3.80%	3.80%	3.80%	3.80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	286,2	284,7	284,1	276,3	370,5
Tasa de interés	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3 136,4**	**3 559,0**	**2 540,6**	**2 388,1**	**2 229,9**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	7 473,7	7 053,6	7 627,9	7 556,3	7 497,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,3	7,8	7,9	7,8	7,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 656,5	2 132,1	2 763,6	2 763,6	2 687,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,9	2,4	2,9	2,9	2,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	187,0	225,0	357,0	1 147,0	943,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3.60/4.00/3.77	3.25/3.30/3.26	3.35/3.50/3.36	3.35/3.95/3.73	3.80 /4.05 / 3.99
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	45,5	54,0	98,5	99,0	81,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,20/0,16	0,15/0,20/0,16	0,15 / 0,20 / 0,16
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	0.0	0.0	0.0	75.7
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$)	**31 Julio 15**	**03 Agosto 15**	**04 Agosto 15**	**05 Agosto 15**	**06 Agosto 15**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	46,4	-75,5	-91,7	185,7	-59,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-121,9	-181,9	-239,7	276,8	-9,1
a. Mercado spot con el público	-155,1	-255,8	-296,4	-77,4	-224,3
i. Compras	701,8	589,5	593,0	662,7	581,9
ii. (-) Ventas	856,9	845,3	889,3	740,0	806,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-61,2	128,6	138,4	43,4	-184,7
i. Pactadas	129,3	166,4	225,2	93,7	59,7
ii. (-) Vencidas	190,4	37,8	86,8	50,2	244,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-229,5	116,1	21,6	212,6	-108,1
i. Pactadas	215,9	470,6	221,4	353,3	392,7
ii. (-) Vencidas	445,4	354,4	199,8	140,7	500,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	219,5	126,0	232,0	288,0	581,0
ii. A futuro	5,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	291,1	347,5	188,7	121,0	328,0
i. Comoras	369,2	348,5	199,0	139,7	469,4
ii. (-) Ventas	78,1	1,0	10,3	18,7	141,4
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-3,0	136,9	12,2	401,7	169,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,1912	3,1934	3,1932	3,2017	3,2047

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera