BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	10 Agosto 15	11 Agosto 15	12 Agosto 15	13 Agosto 15	14 Agosto 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	**2 309,2**	**4 270,4**	**3 630,8**	**3 872,3**	**3 480,6**
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		50,0	50,0	100,0
Propuestas recibidas	200.0		182.0	296.5	343.1
Plazo de vencimiento	185 d		547 d	364 d	90 d
Tasas de interés: Mínima	3,20		3,68	3,40	3,08
Máxima	3.23		3.88	3.40	3.18
Promedio	3,22		3,85	3,40	3,14
Saldo	15 833,2	15 833,2	15 883,2	14 693,2	14 793,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Setiembre de 2015		1 240.0	1 240.0		870.0
Vencimiento de CD BCRP entre el 17 y el 21 de agosto de 2015		1 240.0	1 240.0		0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	500 400				
Plazo de vencimiento	1 300 861				
Tasas de interés: Mínima	7 d 1 d				
Máxima	4,56 4,10				
Promedio	4,56 4,30				
Saldo	4,56 4,12				
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 17 de Agosto de 2015	3 250,0	3 250,0	3 250,0	2 350,0	2 350,0
Vencimiento de REPO entre el 17 y el 21 de agosto de 2015		500.0	500.0		500.0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional		0.0	0.0		0.0
Propuestas recibidas				1 000,0	1 000,0
Plazo de vencimiento				1 505.5	1 488.5
Tasas de interés: Mínima				1 d	3 d
Máxima				2,15	2,70
Promedio				3.15	3.08
Saldo				2.88	2.94
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de agosto de 2015				1 000.0	1 000,0
Vencimientos de Depósitos a Plazo entre el 17 y el 21 de agosto de 2015					1 000,0
iv. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					1 000.0
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 entre el 17 y el 21 de agosto 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 Mayo de 2016		300,0	300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-BN entre el 17 y el 21 de agosto de 2015		0.0	0.0		0.0
vi. Subasta de Certificados de Depositos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)		300 300	300 300		288.5
Propuestas recibidas		591 330	650 300		288.5
Plazo de vencimiento		91 d 93 d	62 d 64 d		63 d
Tasas de interés: Mínima		0.45 0.40	0.39 0.35		0.35
Máxima		0.50 0.50	0.50 0.55		0.55
Promedio		0,47 0,42	0,43 0,47		0,45
Saldo	3 362.0	3 962.0	4 562.0	4 562.0	4 950.5
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 28 de Agosto de 2015		240.0	240.0		240.0
Vencimiento de Depósitos Reajustables entre el 17 y el 21 de agosto 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	12 700,0	12 700,0	12 700,0	12 700,0	12 700,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de Setiembre de 2015		300,0	300,0		300,0
Vencimiento de REPO entre el 17 y el 21 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
Vencimiento de REPO Expansión entre el 17 y el 21 de agosto 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	4 304.7
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el 26 de Mayo de 2017		243,0	243,0		243,0
Vencimiento de REPO de Sustitución entre el 17 y el 21 de agosto de 2015		0.0	0,0		0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300,0	250 300 300	70,0	190 150	180 300 287
Propuestas recibidas	430.0	250 540 450	70.0	190 150	180 310 287
Plazo de vencimiento	92 d	91 d 93 d 93 d	93 d	92 d 92 d	91 d 62 d 94 d
Tasas de interés: Mínima	0,50	0,35 0,34 0,35	0,35	0,55 0,55	0,50 0,50 0,55
Máxima	0,55	0,52 0,46 0,55	0,40	0,55 0,55	0,55 0,55 0,55
Promedio	0.51	0.44 0,40 0.44	0.38	0.55 0.55	0.54 0.54 0.55
Saldo	25 119.0	25 969.0	26 039.0	26 129.0	26 656.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 17 de agosto de 2015		250,0	250,0		900,1
Vencimiento de SC-Venta entre el 17 y el 21 de agosto de 2015		490.0	490.0		3 340.1
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	-64.4	-193.5	-430.5	-349.9
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)		20.0	60.0	133.0	108.0
Tipo de cambio promedio		3.2196	3.2250	3.2371	3.2400
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$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Comoras de CD BCRP v CD BCRP-NR					
ii. Comoras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3 159,2**	**3 606,0**	**2 787,3**	**2 391,8**	**1 742,2**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Comora temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0110%	0.0110%	0.0110%	0.0110%	0.0110%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	220,0				
Tasa de interés	3.80%	3.80%	3.80%	3.80%	3.80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	415,5	365,9	318,1	379,4	150,7
Tasa de interés	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2 963,7**	**3 240,1**	**2 469,2**	**2 012,4**	**1 591,5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	7 454.1	7 495.2	7 406.4	7 498.0	7 389.8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,8	7,8	7,7	7,8	7,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 633,7	2 688,8	2 576,2	2 630,7	2 556,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,7	2,8	2,7	2,7	2,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	783,0	1 478,5	548,0	1 040,0	1 370,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4.00/4.00/4.00	4.00/4.00/4.00	3.80/3.80/3.80	3.25/3.25/3.25	3.25/3.30/3.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	55,0	53,0	37,0	93,5	89,5
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	0,15/0,15/0,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	20.7	0.0	0.0	54.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					54,0 / 3,40
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**07 Agosto 15**	**10 Agosto 15**	**11 Agosto 15**	**12 Agosto 15**	**13 Agosto 15**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-77.8	-57.6	221.8	-52.8	-27.3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-112.2	-77.9	153.0	132.0	-3.6
a. Mercado spot con el público	-244.9	-203.4	-180.7	-178.3	-158.3
i. Compras	660.7	600.0	612.3	571.7	708.2
ii. (-) Ventas	905.5	803.3	793.0	750.0	866.5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	27.8	-7.9	-49.0	-103.6	-91.0
i. Pactadas	146.3	136.4	149.9	46.5	35.7
ii. (-) Vencidas	118.5	144.3	198.9	150.1	126.7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	43,3	65,5	146,6	102.9	-41,5
i. Pactadas	337.6	113.5	389.6	269.6	423.0
ii. (-) Vencidas	294.2	48.0	243.0	166.7	464.5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	578.4	565.2	262.2	688.3	407.4
ii. A futuro	0.0	0.0	0.0	0.0	10.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	287.8	29.9	168.3	80.7	368.8
i. Comoras	291.3	32.5	239.4	161.2	444.1
ii. (-) Ventas	3.5	3.6	71.0	80.6	75.3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	70.6	94.0	473.8	267.9	149.5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2015	3,2009	3,2157	3,2276	3,2344

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera