

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

(Millones de Nuevos Soles)

	24 Agosto 15	25 Agosto 15	26 Agosto 15	27 Agosto 15	28 Agosto 15
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>40,4</b>	<b>871,9</b>	<b>842,3</b>	<b>793,0</b>	<b>385,1</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
<b>a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR</b>					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	50,0	150,0	48,5	50,0	130,0
Plazo de vencimiento	171 d	171 d	533 d	380 d	348
Tasas de interés: Mínima	3,17	3,21	3,88	4,00	3,56
Máxima	3,21	3,21	4,00	3,56	3,56
Promedio	3,20	3,20	3,96	3,52	3,52
Saldo	14 989,7	14 989,7	15 038,2	15 068,2	15 088,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Setiembre de 2015	0,0	870,0	0,0	0,0	870,0
Vencimiento de CD BCRP del 31 de agosto al 4 de setiembre de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	600,0	500,0	300,0	500,0	550,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	3,80	3,35	3,35	3,50	6,50
Máxima	3,80	3,41	3,41	3,50	6,50
Promedio	3,80	3,39	3,35	3,50	6,50
Saldo	2 950,0	2 850,0	2 650,0	2 850,0	2 400,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 4 de Setiembre de 2015	300,0	500,0	300,0	500,0	550,0
Vencimiento de REPO BCRP del 31 de agosto al 4 de setiembre de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas	1 138,6	1 138,6	1 138,6	1 138,6	1 138,6
Plazo de vencimiento	179 d	179 d	179 d	179 d	179 d
Tasas de interés: Mínima	5,74	5,74	5,74	5,74	5,74
Máxima	6,06	6,06	6,06	6,06	6,06
Promedio	5,89	5,89	5,89	5,89	5,89
Saldo	2 749,9	2 749,9	2 749,9	2 749,9	2 749,9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 Noviembre de 2015	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 31 de agosto al 4 de setiembre de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Plazo de vencimiento	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Tasas de interés: Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Coloc-BN del 31 de agosto al 4 de setiembre de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Subasta de Certificados de Depósitos Reservables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Plazo de vencimiento	63 d	63 d	63 d	63 d	63 d
Tasas de interés: Mínima	0,45	0,45	0,45	0,47	0,50
Máxima	0,45	0,45	0,45	0,47	0,50
Promedio	0,47	0,47	0,47	0,47	0,50
Saldo	5 050,5	5 050,5	5 245,5	5 745,9	6 008,5
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 1 de octubre de 2015	240,0	240,0	240,0	240,0	100,0
Vencimiento de CDR BCRP del 31 de agosto al 4 de setiembre de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Plazo de vencimiento	1 757 d	1 095 d	1 095 d	1 095 d	1 095 d
Tasas de interés: Mínima	6,51	6,51	6,31	6,31	4,91
Máxima	6,88	6,88	6,31	6,31	6,31
Promedio	6,63	6,63	6,31	6,31	5,31
Saldo	13 700,0	13 700,0	13 700,0	13 700,0	14 200,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de Setiembre de 2015	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO del 31 de agosto al 4 de setiembre de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas	5 900,0	5 900,0	5 900,0	5 900,0	5 900,0
Plazo de vencimiento	1 757 d	1 095 d	1 095 d	1 095 d	1 095 d
Tasas de interés: Mínima	6,51	6,51	6,31	6,31	4,91
Máxima	6,88	6,88	6,31	6,31	6,31
Promedio	6,63	6,63	6,31	6,31	5,31
Saldo	5 900,0	5 900,0	5 900,0	5 900,0	5 900,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO Expansión del 31 de agosto al 4 de setiembre de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas	4 304,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7
Plazo de vencimiento	243,0	243,0	243,0	243,0	243,0
Tasas de interés: Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	4 304,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017	243,0	243,0	243,0	243,0	243,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 31 de agosto al 4 de setiembre de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	119 13	35 166,5 300 50	135 180	300 300	299,9
Plazo de vencimiento	92 d 31 d	82 d 63 d 63 d 64 d	63 d 63 d	89 d 90 d	550,0
Tasas de interés: Mínima	0,40 0,55	0,55 0,55 0,30 0,55	0,49 0,55	0,55 0,40	0,50
Máxima	0,55 0,55	0,55 0,55 0,55 0,55	0,55 0,55	0,55 0,55	0,50
Promedio	0,42 0,55	0,55 0,55 0,48 0,55	0,51 0,55	0,55 0,52	0,50
Saldo	26 736,9	26 382,4	26 246,4	26 546,4	26 246,3
Próximo vencimiento de SC-Venta el 28 de agosto de 2015	1 800,0	1 800,0	300,0	300,0	400,0
Vencimiento de SC-Venta del 31 de agosto al 4 de setiembre de 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</b>					
i. Compras (millones de US\$)	-163,9	180,0	-197,1	-265,3	1 465,0
ii. Tipo de cambio promedio	50,0	60,0	70,0	81,0	81,0
iii. Ventas (millones de US\$)	3 277,9	3 284,6	3 304,2	3 275,0	0,0
iv. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compras de BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>1 226,5</b>	<b>1 174,9</b>	<b>667,5</b>	<b>977,3</b>	<b>1 184,5</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0,0107%	0,0107%	0,0106%	0,0107%	0,0108%
b. Comisión (tasa efectiva diaria)	440,0	570,0	360,0	360,0	360,0
c. Crédito por recompra monetaria en moneda nacional	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
Tasa de interés	734,6	1 116,6	592,0	393,8	418,6
e. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%	2,00%
Tasa de interés	931,9	828,3	465,5	583,6	765,9
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>					
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	6 577,7	6 536,6	6 596,4	6 521,4	6 431,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,9	6,8	6,9	6,8	6,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 805,2	1 755,1	1 618,6	1 725,7	1 652,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,9	1,8	1,9	1,8	1,8
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 875,0	1 899,0	1 840,0	1 647,5	1 633,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/5,50/3,92	3,15/3,35/3,26	3,25/3,30/3,26	3,25/3,35/3,27	3,25/3,35/3,29
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	25,0	25,0	74,5	74,5	62,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,150/150,15	0,150/150,15	0,150/150,15	0,150/200,18	0,150/150,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	0,0	570,0	570,0	570,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>					
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	-130,5	-65,7	-83,9	-27,6	-265,5
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + g	19,5	635,7	-10,2	43,3	-210,8
a. Mercado spot con el público	-318,2	439,0	-348,8	-155,3	-469,6
i. Compras	862,3	862,1	231,1	274,6	222,2
ii. (-) Ventas	1180,5	423,1	579,9	429,8	712,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-61,2	-83,8	78,2	-22,9	-19,1
i. Pasadas	23,0	78,1	222,1	89,2	95,9
ii. (-) Vencidas	84,2	161,9	143,9	122,1	114,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	53,8	-77,6	11,6	22,0	-264,8
i. Pasadas	184,8	78,3	173,6	138,2	305,3
ii. (-) Vencidas	131,0	156,0	162,0	116,2	570,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	441,9	598,9	378,0	292,0	702,7
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	114,2	149,6	151,3	68,2	525,7
ii. (-) Ventas	116,3	154,5	151,3	103,9	546,0
f. (-) Ventas	2,1	4,9	0,0	35,7	20,3
g. Efecto de Opciones	-26,1	-77,0	-22,1	14,1	142,1
h. Operaciones netas con otras instituciones financieras	261,3	-77,1	87,2	77,0	296,8
i. Crédito por recompra monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2759	3,2793	3,2838	3,3066	3,2762
(*) Datos preliminares					