

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Sol)

	28 Setiembre 15	29 Setiembre 15	30 Setiembre 15	1 Octubre 15	2 Octubre 15
	4 256,7	3 951,9	3 856,0	4 552,9	4 552,9
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	4 256,7	3 951,9	3 856,0	4 552,9	4 552,9
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCRP					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	50,0	200,0	50,0	200,0	200,0
Plazo de vencimiento	130,0	296,5	106,0	286,0	368,0
Tasas de interés: Mínima	164,4	92,4	126,4	91,4	94,4
Máxima	4,15	3,99	4,30	3,99	4,00
Promedio	4,15	4,03	4,40	4,10	4,24
Saldo	16 146,7	16 346,7	16 536,7	16 546,7	16 846,7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Octubre de 2015	1 005,0		1 005,0		1 005,0
Vencimiento de CD BCRP del 5 al 9 de Octubre de 2015	0,0		0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	750,0	750,0	750,0	750,0	750,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 7 de Octubre de 2015	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO BCRP del 5 al 9 de Octubre de 2015	0,0		0,0		300,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 284,0	2 284,0	2 284,0	2 284,0	2 284,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 28 de Octubre de 2015	500,0		500,0		500,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 5 al 9 de Octubre de 2015	0,0		0,0		0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 000,0	1 000,0	1 000,0	1 000,0	1 000,0
Plazo de vencimiento	143,5	143,5	143,5	143,5	143,5
Tasas de interés: Mínima	1,4	1,4	1,4	1,4	1,4
Máxima	3,45	3,40	3,40	3,20	3,30
Promedio	3,50	3,50	3,50	3,50	3,50
Saldo	3,45	3,49	3,44	3,39	3,45
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 5 de Octubre de 2015	2 473,5	2 500,2	2 676,0	400,0	600,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 2 al 8 de Octubre de 2015	2 473,5		2 676,0		600,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 049,9	3 049,9	3 049,9	3 049,9	3 049,9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Noviembre de 2015	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 5 al 9 de Octubre de 2015	0,0		0,0		0,0
vi. 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 20 de Mayo de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Coloc - BN del 5 al 9 de Octubre de 2015	0,0		0,0		0,0
vii. Subasta de Certificados de Depósitos Reestructurables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	300,0		300,0		300,0
Plazo de vencimiento	440,0		440,0		440,0
Tasas de interés: Mínima	92,4		92,4		92,4
Máxima	0,55		0,70		0,15
Promedio	0,65		0,75		0,25
Saldo	0,61	0,73	0,18		0,18
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 9 de octubre de 2015	8 211,1	8 211,1	8 211,1	8 211,1	7 851,1
Vencimiento de CDR BCRP del 5 al 9 de Octubre de 2015	300,0		300,0		280,0
viii. Compra con compromiso de Recombi de moneda extranjera (Reaular)					
Propuestas recibidas	660,0		660,0		260,0
Plazo de vencimiento	200,0		200,0		200,0
Tasas de interés: Mínima	315,0		315,0		375,0
Máxima	1 827,4		369,4		167,4
Promedio	5,03		3,98		4,71
Saldo	5,21		5,08		5,21
Próximo vencimiento de Repo Regular el 5 de Octubre de 2015	15 850,0	15 850,0	15 850,0	15 850,0	16 050,0
Vencimiento de REPO del 1 al 4 de Octubre de 2015	300,0		300,0		300,0
ix. Compra con compromiso de Recombi de moneda extranjera (Exanación)					
Propuestas recibidas	0,0		0,0		0,0
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0
Próximo vencimiento de Repo Exanación el 17 de Enero de 2017	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO Expansion del 5 al 9 de Octubre de 2015	0,0		0,0		0,0
x. Compra con compromiso de Recombi de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 804,7	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
Vencimiento de REPO Sustitución del 1 al 4 de Octubre de 2015	0,0		0,0		0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	300,0	66	300,0		300,0
Plazo de vencimiento	400,0	66	400,0		400,0
Tasas de interés: Mínima	92,4	92,4	92,4		92,4
Máxima	0,20	0,49	0,10		0,05
Promedio	0,70	0,75	0,13		0,30
Saldo	0,48	0,62	0,12		0,19
Próximo vencimiento de SC-Venta el 5 de Octubre de 2015	25 054,3	25 824,3	25 687,3	25 687,3	25 150,3
Vencimiento de SC - Venta del 1 al 4 de Octubre de 2015	600,0		420,0		600,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	2 174,0	0,0	1 137,0	0,0	2 501,9
ii. Ventas (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Compras con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compras de BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 277,2	1 251,7	1 124,0	3 510,0	3 962,9
4. Operaciones monetarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (base efectiva diaria)	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0109%	0,0109%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
Tasa de interés	475,6	636,9	172,1	5,0	29,9
Depósitos Overnight en moneda nacional	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	801,6	714,8	651,9	3 514,0	3 933,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	6 688,3	6 688,7	6 688,4	6 688,4	7 339,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,3	7,3	7,3	8,4	8,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 034,4	2 034,4	2 034,4	1 998,9	2 960,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,2	2,2	2,1	2,1	3,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	757,0	817,5	824,5	1 055,0	1 187,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,503/5,0/3,50	3,503/5,0/3,50	3,503/5,0/3,50	3,503/5,0/3,50	3,503/5,0/3,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	76,5	70,5	36,0	53,0	115,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,150/150/15,0	0,150/150/15,0	0,150/150/15,0	0,150/150/15,0	0,150/250/20,0
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 de moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	25 Setiembre 15	28 Setiembre 15	29 Setiembre 15	30 Setiembre 15	01 Octubre 15
Flujo de la posición global = a + b + c + e + f + g	-208,3	139,3	-115,8	-23,5	119,5
Flujo de la posición contable = a + b + c + d + e + f + g	186,3	67,9	-110,4	64,9	-126,5
a. Mercado spot con el público	-280,9	-185,5	-239,9	-156,2	-152,8
i. Compras	292,1	290,8	229,0	279,6	238,6
ii. (i) Ventas	273,0	481,4	469,9	432,9	391,4
b. Compra forward al público (con y sin entrada)	71,0	17,0	67,2	-67,8	208,2
i. Paquetes	166,6	169,8	300,4	214,6	310,0
ii. (i) Vencidas	95,7	152,9	232,2	262,5	103,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrada)	73,7	-60,8	1,5	-31,8	-75,5
i. Paquetes	201,2	244,1	107,9	191,9	268,8
ii. (i) Vencidas	121,5	304,9	156,5	223,1	344,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
Al contado	315,0	200,2	414,0	519,3	698,0
ii. Al futuro	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrada	199,3	270,4	51,3	191,2	298,4
f. Compras	111,9	303,1	153,1	221,1	325,6
ii. (i) Ventas	2,6	32,6	101,8	38,9	57,2
g. Efecto de Deceas	17,9	12,2	5,3	5,3	3,6
h. Operaciones netas con otras instituciones financieras	14,9	-43,9	-75,1	-43,9	-40,8
i. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
ii. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Neto: Total del mercado interbancario promedio (Fuente: Databank)	3,2211	3,2366	3,2392	3,2211	3,2314
ii. Efecto de Deceas					