

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	5 Octubre 15	6 Octubre 15	7 Octubre 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	4 391,1	5 453,4	5 215,1
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		22,3
Plazo de vencimiento	123,0		83,4
Tasas de interés: Mínima	165,0		247,0
Máxima	4,15		4,35
Promedio	4,48		4,80
Saldo	4,35		4,57
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Octubre de 2015	16 896,7	16 896,7	16 919,0
Vencimiento de CD BCRP del 12 al 16 de Octubre de 2015	1 005,0	1 005,0	1 005,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			
Propuestas recibidas	700,0		1 005,0
Plazo de vencimiento	1 500,0		1 005,0
Tasas de interés: Mínima	7,4		3,02
Máxima	3,78		3,02
Promedio	3,80		3,02
Saldo	3,78		3,02
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 12 de Octubre de 2015	1 450,0	1 450,0	1 150,0
Vencimiento de REPO BCRP del 12 al 16 de Octubre de 2015	700,0	700,0	700,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)			
Propuestas recibidas	0,0		700,0
Plazo de vencimiento			700,0
Tasas de interés: Mínima			700,0
Máxima			700,0
Promedio			700,0
Saldo			
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 28 de Octubre de 2015	2 284,0	2 284,0	2 284,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 12 al 16 de Octubre de 2015	500,0	500,0	500,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			
Propuestas recibidas	400,0	1 500,0	2 000,1
Plazo de vencimiento	1 431,9	3 029,0	3 009,9
Tasas de interés: Mínima	1,4	1,4	5,4
Máxima	3,22	3,10	2,85
Promedio	3,22	3,16	3,02
Saldo	400,0	1 500,0	2 000,1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 12 de Octubre de 2015	400,0	1 500,0	2 000,1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 12 al 16 de Octubre de 2015	400,0	1 500,0	2 000,1
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
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 Noviembre de 2015	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP del 12 al 16 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
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc - BN del 12 al 16 de Octubre de 2015	0,0	0,0	0,0
vii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	7 851,1	7 851,1	7 851,1
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 14 de octubre de 2015	260,0	260,0	300,0
Vencimiento de CDR BCRP del 12 al 16 de Octubre de 2015	260,0	260,0	300,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	16 250,0	16 250,0	16 250,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 28 de Octubre de 2015	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de REPO del 12 al 16 de Octubre de 2015	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	7 900,0	7 900,0	7 900,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO Expansión del 12 al 16 de Octubre de 2015	0,0	0,0	0,0
x. Compra con compromiso de Recompra 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
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017	243,0	243,0	243,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 12 al 16 de Octubre de 2015	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	24 550,3	24 250,4	23 397,4
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de Octubre de 2015	599,9	700,0	699,9
Vencimiento de SC - Venta del 12 al 16 de Octubre de 2015	1 851,9	1 852,0	2 831,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR			
i. Compras (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)			
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0
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	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTP			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	4 641,1	3 953,4	3 192,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).			
Comisión (tasa efectiva diaria)			
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0109%	0,0109%	0,0109%
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 893,0	772,7	927,2
Tasa de interés	2,25%	2,25%	2,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	2 748,1	3 180,7	2 265,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	8 354,4	8 449,8	8 263,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,9	9,0	8,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	3 628,4	3 633,0	3 419,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,8	3,9	3,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 110,5	1 052,0	552,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,75/3,65	3,50/3,55/3,50	3,30/3,50/3,40
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	80,0	44,0	117,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,50/0,50/0,50	0,50/0,55/0,50	0,50/0,50/0,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP: CDBCRP-NR y CDV	110,0	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	10,04,15		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)			
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	02 Octubre 15	05 Octubre 15	06 Octubre 15
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-116,8	-72,0	128,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-116,0	65,4	71,4
a. Mercado spot con el público	-155,8	-89,2	-23,8
i. Compras	164,4	169,4	240,8
ii. (-) Ventas	320,2	258,6	264,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	123,6	60,5	46,8
i. Pacladas	318,0	168,3	216,4
ii. (-) Vencidas	194,1	228,7	170,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-2,0	-114,2	-110,5
i. Pacladas	152,6	57,8	219,7
ii. (-) Vencidas	154,6	172,0	330,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	473,5	355,5	268,5
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	123,4	100,5	252,9
i. Compras	154,0	161,2	326,3
ii. (-) Ventas	30,6	60,6	75,4
f. Efecto de Operaciones	5,6	-2,0	-3,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-255,4	-191,9	-94,1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2236	3,2144	3,2224
(*) Datos preliminares			