

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	26 Octubre 15	27 Octubre 15	28 Octubre 15	29 Octubre 15	30 Octubre 15
	3 856.0	3 866.3	3 746.7	3 746.8	4 145.4
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 856.0	3 866.3	3 746.7	3 746.8	4 145.4
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		30.0	50.0	
Plazo de vencimiento	246.9		106.1	206.0	
Tasas de interés: Mínima	154.4		125.4	143.4	
Máxima	4.14		4.40	4.40	
Promedio	4.17		4.40	4.40	
Saldo	17 718.0	17 718.0	17 748.0	17 798.0	17 798.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 5 de Noviembre de 2015	375.0		375.0		375.0
Vencimiento de CD BCRP del 2 al 6 de Noviembre de 2015	0.0		0.0		375.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	450.0	450.0	450.0	450.0	450.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 23 de Diciembre de 2015	150.0		150.0		150.0
Vencimiento de REPO BCRP del 2 al 6 de Noviembre de 2015	0.0		0.0		0.0
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 27 de Noviembre de 2015	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 2 al 6 de Noviembre de 2015	0.0		0.0		0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	701.0	1 539.0	1 000.0	1 170.8	999.9
Plazo de vencimiento	1539.0	1 299.5	1 299.5	1 299.5	1 017.0
Tasas de interés: Mínima	1.4	1.4	1.4	1.4	1.4
Máxima	3.49	3.49	3.49	3.49	3.49
Promedio	3.50	3.49	3.49	3.48	3.48
Saldo	2 720.0	2 700.0	2 710.9	2 600.0	2 883.1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 2 de Noviembre de 2015	2 240.0		2 240.0		2 240.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 2 al 6 de Noviembre de 2015	0.0		0.0		0.0
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 2 al 6 de Noviembre 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 Mayo de 2016	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de Coloc - BN del 2 al 6 de Noviembre de 2015	0.0		0.0		0.0
vii. Subasta de Certificados de Depósitos Reestructurados del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Plazo de vencimiento	400.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Tasas de interés: Mínima	59.4	59.4	59.4	59.4	59.4
Máxima	0.50	0.70	0.50	0.40	0.75
Promedio	0.65	0.72	0.73	0.50	0.61
Saldo	6 983.8	7 283.9	7 388.4	7 388.4	7 233.4
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 5 de Noviembre de 2015	895.0		150.0		565.0
Vencimiento de CDR BCRP del 2 al 6 de Noviembre de 2015	850.4		155.4		865.0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	15 950.0	15 950.0	15 950.0	15 950.0	15 950.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 16 de Noviembre de 2015	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de REPO del 2 al 6 de Noviembre de 2015	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exansión)					
Propuestas recibidas					
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 Exansión el 17 de Enero de 2017	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de REPO Exansión del 2 al 6 de Noviembre 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	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 el 2 al 6 de Noviembre de 2015	0.0		0.0		0.0
xi. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	300.0	76.4	100	300	165
Plazo de vencimiento	332.0	226.4	100	300	165
Tasas de interés: Mínima	0.75	0.64	0.74	0.69	0.59
Máxima	0.75	0.75	0.74	0.69	0.75
Promedio	0.72	0.66	0.74	0.69	0.61
Saldo	22 662.8	22 746.3	22 691.3	22 638.3	23 000.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 3 de Noviembre de 2015	616.5		140.0		300.0
Vencimiento de SC - Venta del 2 al 6 de Noviembre de 2015	1 121.5		140.0		730.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neoposición del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0.0	-16.4	-26.3	-98.6	0.0
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
Compras con el Tesoro Público (millones de US\$)	0.0	3 279.8	3 297.1	3 297.1	0.0
Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	969.0	1 369.6	793.5	1 092.2	1 462.4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (base efectiva diaria)	0.0108%	0.0107%	0.0107%	0.0107%	0.0107%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%	4.05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	3.95%	3.95%	3.95%	3.95%	3.95%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	999.7	1 411.1	845.6	649.9	699.8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	6 625.1	6 661.6	6 617.4	6 603.0	6 422.6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.0	7.0	7.0	6.8	6.8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 903.4	1 951.5	1 901.2	1 757.2	1 721.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.0	2.1	2.0	1.8	1.8
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,500,603,356	3,603,603,60	3,502,503,50	3,502,503,50	3,502,503,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	149.0	85.0	45.0	45.0	35.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0.150,150,15	0.150,150,15	0.150,150,15	0.150,150,15	0.150,150,15
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 en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	23 Octubre 15	26 Octubre 15	27 Octubre 15	28 Octubre 15	29 Octubre 15
Flujo de la posición global = a + b + c + e + f + g	188.1	4.1	7.1	52.0	15.3
Flujo de la posición contable = a + b + c - d + e + f + g	72.6	84.4	76.4	35.9	65.6
a. Mercado spot con el público	-87.5	-47.6	-52.2	-41.1	-41.1
i. Compras	222.8	169.6	227.6	215.4	210.8
ii. (i) Ventas	320.3	217.1	256.2	267.6	251.9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	75.9	63.2	28.1	87.4	-158.8
i. Facturas	171.9	63.3	70.0	166.7	75.2
ii. (i) Vencidas	96.0	156.5	96.1	244.1	274.1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	64.0	-20.5	83.0	-69.2	91.1
i. Facturas	154.1	230.9	193.3	236.4	174.3
ii. (i) Vencidas	90.1	251.4	110.3	305.6	83.2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
ii. Al contado	600.0	452.3	713.8	606.6	293.5
iii. Al futuro	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	63.3	59.3	130.9	86.5	-86.5
f. Compras	72.3	247.4	105.3	305.0	179.9
ii. (i) Ventas	9.0	78.3	50.0	168.4	168.4
g. Efecto de Docenas	11.7	38.7	17.4	63.3	8.9
h. Operaciones netas con otras instituciones financieras	162.8	10.4	84.1	-0.3	250.0
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)	3,265.0	3,270.6	3,270.2	3,279.0	3,289.1
ii. Efecto de Docenas					