

ANEXO 1

HORARIO DEL SERVICIO DE COMPENSACIÓN DE TRANSFERENCIAS INMEDIATAS

ACTIVIDAD		Horario	
		D	D+1
1	Ciclo Operativo en la ESEC		
	Ciclo Operativo del servicio de Transferencias Inmediatas	16:00	16:20
2	Horario Operativo del servicio de Transferencias Inmediatas		
	Cliente ordena a Participante Originante el envío de una Transferencia Inmediata. ESEC envía Orden de Transferencia Inmediata al Sistema.	16:00	16:00
3	Cálculo del Saldo Operativo Objetivo y Constitución Noche		
	ESEC calculan para cada Participante, el Saldo Operativo Objetivo Noche y transmiten la información al BCRP para que acredite los fondos en las cuentas respectivas.	16:20 a 16:40	
4	Cálculo del Saldo Operativo Objetivo y Constitución Día		
	- ESEC calculan, para cada Participante, el Saldo Operativo Objetivo Día y transmiten la información al BCRP. El BCRP acredita los fondos en la Cuenta de Recursos Específicos de cada Participante o devuelve a Cuenta Liquidadora, según corresponda.		08:15 a 08:35
5	Compensación y Liquidación		
	ESEC calculan las posiciones netas bilaterales y multilaterales por cada Participante y transmiten el resultado de la Compensación al BCRP. El BCRP debita las cuentas de Recursos Específicos de los Participantes con Posición Neta Multilateral Deudora y acredita las cuentas de los Participantes con Posición Neta Multilateral Acreedora		16:00 a 16:20
6	ESEC envían reportes a Participantes		
	Las ESEC generan y envían reportes de posiciones bilaterales, transacciones emitidas y recibidas e información correspondiente al ciclo anterior		16:30 - 17:30
7	Ampliación de Recursos Específicos (Ventana de Tiempo de Ajuste de Liquidez)		
	Las ESEC pueden instruir al BCRP la acreditación de fondos (ampliación de garantías) en las Cuentas de Recursos Específicos de los Participantes.		08:15 - 15:45 en Días Hábiles

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

ANEXO 2 PARÁMETROS DE SEGURIDAD Y NIVELES DE ALERTA

Parámetro	Descripción	% del saldo inicial de la Cuenta Operativa
Saldo Mínimo Absoluto	Nivel que define el mínimo importe de la Cuenta Operativa en cualquier momento.	8
Alerta Informativa	Nivel que desencadena un aviso a la Entidad Participante.	≤ 30
Alerta de Ampliación	Nivel que desencadena la ampliación de fondos en la Cuenta de Recursos Específicos.	≤ 25
Incremento por Ampliación	Monto mínimo en el que se incrementa la Cuenta de Recursos Específicos por ampliación de fondos.	30