

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

	13 Abril 15	14 Abril 15	15 Abril 15	16 Abril 15	17 Abril 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	2 588,2	2 185,5	1 930,3	2 688,0	2 297,7
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	192,7	50,0	50,0	355,0
Plazo de vencimiento	284,7	540 d	540 d	540 d	357 d
Tasas de interés: Mínima	3,21	3,40	3,40	3,21	3,21
Máxima	3,21	3,46	3,46	3,21	3,21
Promedio	3,21	3,40	3,40	3,21	3,21
Saldo	16 383,2	16 383,2	16 433,2	15 983,2	15 383,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 23 de Abril de 2015			1 100,0	200,0	200,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 20 y el 24 de Abril de 2015			1 100,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 900,0	1 900,0	1 900,0	1 900,0	1 900,0
Próximo vencimiento de Repo el 16 de Mayo de 2015			300,0	300,0	300,0
Vencimientos de Repo entre el 20 y el 24 de Abril de 2015			0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	700,0	200,0	1 185,0	130,0	130,0
Plazo de vencimiento	725,1	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de interés: Mínima	1,0	2,50	4,40	4,41	4,41
Máxima	3,25	4,60	4,60	4,41	4,41
Promedio	3,11	4,50	4,50	4,25	4,25
Saldo	700,0	700,0	700,0	700,0	700,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 4 de Abril de 2015					
Vencimientos de Depósitos a Plazo entre el 20 y el 24 de Abril de 2015					
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	630,0	630,0	630,0	500,0	500,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 22 de Abril de 2015				200,0	200,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 20 y el 24 de abril 2015				300,0	300,0
v. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas			300,0	1 210,0	300,0
Plazo de vencimiento			366 d	366 d	366 d
Tasas de interés: Mínima			4,40	4,12	4,41
Máxima			4,60	4,41	4,41
Promedio			4,50	4,25	4,25
Saldo	8 600,0	8 900,0	9 200,0	9 200,0	9 200,0
Próximo vencimiento de Repo el 21 de Septiembre de 2015			300,0	300,0	300,0
Vencimientos de Repo entre el 20 y el 24 de Abril de 2015			0,0	0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 700,0	2 700,0	2 700,0	2 700,0	3 300,0
Próximo vencimiento de Repo el 17 de Enero de 2017				300,0	300,0
Vencimientos de Repo entre el 20 y el 24 de abril 2015			0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0
Próximo vencimiento de Repo el 26 de Enero de 2016				200,0	200,0
Vencimientos de Repo entre el 20 y el 24 de abril 2015				0,0	0,0
viii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	600,0	600,0	600	600,0	300
Plazo de vencimiento	1 542,0	1 462,0	1 240,0	1 210,0	1 240
Tasas de interés: Mínima	67 d	70 d	70 d	70 d	70 d
Máxima	-1,22	-0,92	-0,6	-1,22	-1,15
Promedio	-0,76	-0,55	-0,2	-0,80	-0,87
Saldo	-0,99	-0,72	-0,4	-0,96	-1,03
Próximo vencimiento de SC-Venta el 20 de Abril de 2015	24 180,1	23 980,1	24 180,1	24 180,1	24 480,1
Vencimientos de SC-Venta entre el 20 y el 24 de abril 2015				600,0	300,0
ix. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	-552,9	0,0	900,0	300,0	1 500,0
ii. Ventas (millones de US\$)	177,0	0,0	85,0	0,0	5,0
Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	3 129,6	0,0	3 125,0	0,0	3 125,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	0,0	0,0
ii. Compras de BTP					
Saldo	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 285,3	1 985,5	1 914,6	2 618,0	2 882,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0112%	0,0113%	0,0112%	0,0113%	0,0112%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	600,0	600,0	610,0	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 Overnigh en moneda nacional	154,6	483,5	1 507,5	1 344,9	1 600,3
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 730,7	2 102,0	1 017,1	1 273,1	1 281,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	7 553,1	8 948,7	8 559,7	8 526,2	8 417,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	-1,22	7,8	9,3	8,9	8,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	3 205,1	2 860,2	2 737,4	2 710,3	2 604,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,8	3,2	2,8	2,8	2,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	871,7	1 126,0	1 176,0	1 409,0	743,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,25/3,35/3,27	3,25/3,40/3,35	3,25/3,40/3,33	3,30/3,40/3,33	3,25/3,40/3,40
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	100,0	6,0	2,0	0,0	15,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	50,0	0,15/0,15/0,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	100,8	80,0	27,0	50,0	65,6
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		55,0 / 3,20			50,0 / 3,20
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	10 Abril 15	13 Abril 15	14 Abril 15	15 Abril 15	16 Abril 15
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f	-138,3	68,0	-136,2	2,0	-60,4
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f	13,2	146,8	-168,4	60,0	-164,8
a. Mercado spot con el público	-94,9	-105,5	-69,9	-85,1	-117,1
i. Compras	517,9	420,0	511,6	502,9	515,6
ii. (-) Ventas	602,8	525,5	580,6	588,0	687,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	166,7	107,7	107,7	69,4	-238,6
i. Placadas	204,9	145,9	410,8	172,0	45,7
ii. (-) Vencidas	38,2	39,6	303,0	102,6	284,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	411,0	11,8	-29,2	217,0	-348,1
i. Placadas	503,5	230,2	251,6	491,5	155,4
ii. (-) Vencidas	92,5	215,4	280,9	274,5	503,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	978,1	727,0	929,5	998,0	626,0
ii. A futuro	30,0	13,0	70,0	25,0	25,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	81,9	95,6	239,3	222,7	275,2
i. Compras	87,8	211,0	271,0	250,4	500,4
ii. (-) Ventas	5,9	121,4	31,1	27,7	225,2
f. Operaciones tasas con otras instituciones financieras	163,2	162,2	-105,8	183,9	-54,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,1225	3,1254	3,1191	3,1250	3,1241
(*) Datos preliminares					