

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	30 Marzo 15	31 Marzo 15	01 Abril 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	254,4	-386,9	183,1
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		50,0
Plazo de vencimiento	124,0		95,0
Tasas de interés: Mínima	199 d		554 d
Máxima	3,26		3,49
Promedio	3,26		3,49
Saldo	18 343,3	18 343,3	18 393,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 9 de Abril de 2015			2 210,1
Vencimientos de CD BCRP entre el 6 y 10 de Abril de 2015			2 210,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1 000,0	1 000,0 500,0 1 000,0	1 000,0 2 500,0
Propuestas recibidas	1 130,0	1 400,0 1 430,0 1 040,0	2 410,0 2 710,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d 7 d 1 d	5 d 5 d
Tasas de interés: Mínima	3,91	3,93 4,00 3,91	3,51 3,26
Máxima	3,91	3,93 4,00 3,91	4,02 3,80
Promedio	3,91	3,93 4,00 3,91	3,77 3,67
Saldo	3 400,0	4 900,0	6 400,0
Próximo vencimiento de Repo el 6 de Abril de 2015			4 000,0
Vencimientos de REPO entre el 6 y 10 de Abril de 2015			4 500,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	1 935,0	1 935,0	1 785,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 6 de Abril de 2015			300,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 6 y 10 de abril 2015			855,0
v. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	8 600,0	8 600,0	8 600,0
Próximo vencimiento de Repo el 21 de Setiembre de 2015			300,0
Vencimientos de REPO entre el 6 y el 10 de Abril de 2015			0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)			
Propuestas recibidas			500,0
Plazo de vencimiento			1 155,0
Tasas de interés: Mínima			1 101 d
Máxima			4,06
Promedio			4,35
Saldo	2 600,0	2 600,0	3 100,0
Próximo vencimiento de Repo el 17 de Enero de 2017			300,0
Vencimientos de REPO entre el 6 y el 10 de abril 2015			0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	1 500,0	1 500,0	1 500,0
Próximo vencimiento de Repo el 26 de Enero de 2018			200,0
Vencimientos de REPO entre el 6 y el 10 de abril 2015			0,0
viii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300,0	300,0	-300,0 300,0
Propuestas recibidas	750,0	990,0	924,0 844,0
Plazo de vencimiento	60 d	59 d	61 d 62 d
Tasas de interés: Mínima	-1,17	-1,27	-1,17 -1,02
Máxima	-0,77	-1,01	-1,01 -0,61
Promedio	-0,98	-1,15	-1,10 -0,76
Saldo	21 280,1	21 280,1	20 980,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 6 de Abril de 2015			400,0
Vencimientos de SC-Venta entre el 6 y el 10 de abril 2015			3 400,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio			
ii. Ventas (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público			
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público			
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR			
ii. Compras de BTP			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 204,4	2 113,1	4 133,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0114%	0,0114%	0,0114%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	405,0		
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	497,1	520,0	162,5
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 112,3	1 593,1	3 970,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	8 434,1	7 949,5	9 615,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,8	8,3	16,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 570,2	2 304,2	3 970,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,9	2,4	6,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 285,0	359,0	60,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,45/3,70/3,58	3,60/3,80/3,70	3,40/3,40/3,40
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	30,0	0,0	15,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,20/0,20/0,20		0,15/0,15/0,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	257,7	0,0	0,0
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\$)	27 Marzo 15	30 Marzo 15	31 Marzo 15
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	150,8	-125,2	53,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	44,4	79,5	-65,1
a. Mercado spot con el público	-206,2	-89,2	-608,9
i. Compras	772,0	637,8	720,7
ii. (-) Ventas	978,2	727,0	1329,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	65,0	120,4	-208,2
i. Pactadas	282,1	340,8	516,1
ii. (-) Vencidas	217,1	220,4	724,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	152,7	323,0	-328,3
i. Pactadas	438,8	549,8	319,8
ii. (-) Vencidas	286,0	226,8	648,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	929,5	711,0	651,4
ii. A futuro	53,0	75,0	45,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	213,6	175,0	488,0
i. Compras	275,5	222,1	643,9
ii. (-) Ventas	61,9	47,2	156,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	300,1	-2,0	-22,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,0916	3,0960	3,0959
(*) Datos preliminares			