

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	4 Mayo 15		5 Mayo 15		6 Mayo 15		7 Mayo 15		8 Mayo 15	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1 881,8		2 063,8		3 168,3		5 103,0		4 826,3	
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		50,0		50,0		50,0	
Plazo de vencimiento	156,8		152,0		152,0		256,2		256,2	
Tasas de interés: Mínima	182 d		554 d		371 d		371 d		371 d	
Máxima	3,18		3,50		3,50		3,16		3,16	
Promedio	3,45		3,50		3,50		3,16		3,16	
Saldo	3,27		3,50		3,50		3,16		3,16	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Mayo de 2015	15 504,6		15 504,6		15 564,6		13 823,5		13 929,5	
Vencimientos de REPO entre el 11 y el 15 de Mayo de 2015										
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)										
Propuestas recibidas	1 000,0		500,0		1 000,0		1 675,1		1 675,1	
Plazo de vencimiento	2 583,0		1 300,0		2 195,0		1 542,0		1 600,0	
Tasas de interés: Mínima	1 d		7 d		1 d		30 d		7 d	
Máxima	4,07		4,20		4,21		4,23		3,25	
Promedio	4,10		4,35		4,36		4,26		4,40	
Saldo	4,07		4,25		4,23		4,23		4,15	
Próximo vencimiento de Repo el 11 de Mayo de 2015										
Vencimientos de REPO entre el 11 y el 15 de Mayo de 2015										
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 11 de Mayo de 2015										
Vencimientos de Depósitos a Plazo entre el 29 y el 30 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	300,0		300,0		300,0		300,0		300,0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 7 de Julio de 2015										
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 11 y el 15 de mayo 2015										
v. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	9 500,0		9 500,0		10 000,0		10 000,0		10 000,0	
Próximo vencimiento de Repo el 21 de Setiembre de 2015										
Vencimientos de REPO entre el 11 y el 15 de Mayo de 2015										
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	3 900,0		3 900,0		3 900,0		3 900,0		3 900,0	
Próximo vencimiento de Repo el 17 de Enero de 2017										
Vencimientos de REPO entre el 11 y el 15 de Mayo 2015										
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	2 150,0		2 150,0		2 150,0		2 150,0		2 550,0	
Próximo vencimiento de Repo el 27 de Enero de 2018										
Vencimientos de REPO entre el 11 y el 15 de mayo 2015										
viii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP										
Propuestas recibidas	300,0		300,0		300,0		300,0		300,0	
Plazo de vencimiento	870,0		600,0		535,0		910,0		475,0	
Tasas de interés: Mínima	65 d		66 d		67 d		69 d		70 d	
Máxima	-0,91		-0,57		-0,51		-1,31		-0,31	
Promedio	-0,47		-0,41		-0,11		-0,26		-0,01	
Saldo	-0,69		-0,52		-0,34		-0,68		-0,12	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 de Mayo de 2015	26 465,1		26 525,1		26 525,1		26 785,1		26 485,1	
Vencimientos de SC-Venta entre el 11 y el 15 de mayo 2015										
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-472,1		0,0		0,0		0,0		0,0	
i. Compras (millones de US\$)										
Tipo de cambio promedio										
ii. Ventas (millones de US\$)	150,0		25,0		10,0		10,0		10,0	
Tipo de cambio promedio	3,1475		3,1510		3,1523		3,1523		3,1523	
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0		0,0		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		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	3 859,7		3 723,8		4 539,6		4 721,4		4 826,3	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).										
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0112%		0,0112%		0,0112%		0,0111%		0,0112%	
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 Overnigh en moneda nacional										
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	3 374,6		3 244,9		4 060,4		3 042,2		2 841,7	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	7 722,7		7 945,0		9 455,6		7 835,3		8 018,0	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,0		8,5		9,7		8,1		8,3	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 908,5		2 352,4		2 637,1		2 604,2		2 792,8	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0		2,3		2,7		2,7		2,9	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	646,0		1 412,0		767,0		1 082,0		978,0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,05/4,00		4,00/4,30/4,03		3,95/4,00/4,00		3,60/3,75/3,64		3,65/3,65/3,65	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	25,0		91,0		99,0		89,0		0,0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15		0,15/0,15/0,15		0,15/0,15/0,15		0,15/0,15/0,15		50,0	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0		0,0		0,0		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\$)	30 Abril 15		04 Mayo 15		05 Mayo 15		6 Mayo 15		7 Mayo 15	
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f	67,6		-84,9		-205,5		-38,3		284,9	
Flujo de la posición contable = a + b - i - c + e + f	76,2		15,8		-246,2		-290,7		114,2	
a. Mercado spot con sin entrega	-79,0		215,2		-223,3		-319,8		-56,3	
i. Compras	303,2		277,5		314,8		202,8		366,4	
ii. (-) Ventas	-382,2		-492,7		-538,1		-521,6		-422,6	
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	10,0		-46,5		264,3		82,8		-294,9	
i. Pactadas	202,5		145,4		297,4		258,6		172,0	
ii. (-) Vencidas	192,5		191,9		33,1		175,9		466,9	
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	110,8		155,0		237,7		-134,0		-387,9	
i. Pactadas	347,2		400,4		495,1		310,8		217,7	
ii. (-) Vencidas	236,4		245,4		257,4		444,8		605,6	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	924,4		757,7		901,5		1051,3		1247,2	
ii. A futuro	10,0		20,0		0,0		0,0		0,0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forward sin entrega	195,2		140,0		217,4		312,2		293,7	
i. Compras	229,9		213,0		222,9		444,1		604,8	
ii. (-) Ventas	-34,7		73,0		5,5		131,9		311,1	
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	96,1		235,3		-3,0		20,4		93,2	
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,1278		3,1439		3,1487		3,1465		3,1541	
(*) Datos preliminares										