

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	9 Febrero 15	10 Febrero 15	11 Febrero 15	12 Febrero 15	13 Febrero 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	4 694,8	4 464,7	4 817,8	4 720,1	4 360,0
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	100,0	100,0	100,0	100	200
Plazo de vencimiento	433,5	371,5	294,0	355,2	614,3
Tasas de interés: Mínima	185 d	184 d	547 d	364 d	182 d
Máxima	3,10	3,24	3,30	3,20	3,10
Promedio	3,30	3,25	3,31	3,20	3,20
Saldo	3,27	3,24	3,31	3,20	3,19
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Marzo de 2015	18 155,3	18 255,3	18 355,3	17 585,3	17 585,3
Vencimientos de CD BCRP entre el 16 y el 20 de Febrero de 2015			1 070,0	820,0	820,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
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 Repo el 5 de Marzo de 2015					
Vencimientos de REPO entre el 16 y el 20 de Febrero de 2015			0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	999,9	1 400,0	1 800,1	1 524,2	1 800,0
Plazo de vencimiento	1 196,0	1 890,5	2 088,1	1 524,2	1 947,9
Tasas de interés: Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	2,90	2,98	2,97	3,00	3,00
Promedio	3,20	3,23	3,20	3,25	3,25
Saldo	3,05	3,12	3,03	3,14	3,15
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 16 de Febrero de 2015	999,9	1 400,0	1 800,1	1 524,2	3 800,0
Vencimientos de Depósitos a Plazo entre el 16 y el 20 de Febrero de 2015			1 800,1	1 524,2	3 800,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	300,0		300,0		
Plazo de vencimiento	345,0		510,0		
Tasas de interés: Mínima	60 d		61 d		
Máxima	-0,05		0,00		
Promedio	0,05		0,00		
Saldo	0,01		0,00		
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 24 de Febrero de 2015	2 585,0	2 585,0	2 885,0	2 885,0	2 885,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 16 y el 20 de Febrero de 2015			300,0	300,0	300,0
v. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	8 900,0	8 900,0	8 900,0	8 900,0	8 900,0
Próximo vencimiento de Repo el 19 de Febrero de 2015					
Vencimientos de REPO entre el 16 y el 20 de Febrero de 2015			300,0	300,0	300,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	900,0	900,0	900,0	900,0	900,0
Próximo vencimiento de Repo el 17 de Enero de 2017					
Vencimientos de REPO entre el 16 y el 20 de Febrero de 2015			300,0	300,0	300,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Próximo vencimiento de Repo el 26 de Enero de 2018					
Vencimientos de REPO entre el 16 y el 20 de Febrero de 2015			200,0	200,0	200,0
viii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas		300,0	300		
Plazo de vencimiento		850,0	840	360	
Tasas de interés: Mínima		64 d	64 d	89 d	
Máxima		-0,82	-1,26	0,01	
Promedio		-0,67	-1,01	0,01	
Saldo		-0,79	-1,14	0,01	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 19 de Febrero de 2015	20 198,5	20 498,5	21 098,5	21 098,5	21 098,5
Vencimientos de SC-Venta entre el 16 y el 20 de Febrero de 2015			300,1	300,1	300,1
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	-616,6	-541,0	0,0	-277,4
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\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	3 294,9	2 348,1	2 076,7	2 895,9	2 282,6
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0115%	0,0114%	0,0114%	0,0114%	0,0114%
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	362,7	235,0	124,5	30,3	17,8
	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	2 932,2	2 113,1	1 952,2	2 865,6	2 264,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	9 898,3	9 840,4	9 818,0	9 744,1	9 615,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,3	10,2	10,2	10,1	10,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	3 691,9	3 651,7	3 497,2	3 445,1	3 273,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,8	3,7	3,6	3,6	3,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	302,0	735,0	896,0	810,0	1 003,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,25/3,25/3,25	3,25/3,25/3,25	3,25/3,30/3,26	3,25/3,30/3,25	3,25/3,30/3,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	308,0	320,0	334,0	286,8	298,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,25/0,40/0,29	0,30/0,35/0,31	0,30/0,30/3,30	0,30/0,30/3,30	0,30/0,30/3,30
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	1,0	16,0	190,0	100,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		1,0 / 3,30			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	06 Febrero 15	09 Febrero 15	10 Febrero 15	11 Febrero 15	12 Febrero 15
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	199,8	16,1	20,8	-14,7	-27,2
a. Mercado spot con el público	204,5	50,5	15,0	183,7	-229,8
i. Compras	42,1	-189,8	-254,5	-174,5	-416,1
ii. (-) Ventas	340,2	175,5	223,7	319,1	326,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	298,1	365,4	478,2	493,5	742,7
i. Pactadas	-111,5	-93,6	-138,3	-86,2	-24,2
ii. (-) Vencidas	60,9	92,7	76,9	119,4	317,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	172,3	186,2	215,3	205,6	341,2
i. Pactadas	88,7	-59,1	-46,6	306,2	-226,8
ii. (-) Vencidas	237,9	170,1	235,8	614,4	400,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias	149,1	229,2	282,4	308,2	627,2
i. Al contado	438,5	655,1	417,4	889,0	621,2
ii. A futuro	63,0	108,0	170,0	150,0	135,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	49,2	185,7	149,7	198,8	487,0
i. Compras	133,3	226,4	280,2	308,1	624,2
ii. (-) Ventas	84,1	40,7	130,4	109,2	137,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	285,5	97,7	284,5	456,0	-14,8
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,0685	3,0647	3,0774	3,0928	3,0775
(*) Datos preliminares					