

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

(Millones de Nuevos Soles)

	09 Marzo 15	10 Marzo 15	11 Marzo 15	12 Marzo 15	13 Marzo 15
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>970,3</b>	<b>1 285,0</b>	<b>1 814,1</b>	<b>2 248,2</b>	<b>1 661,0</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
<b>a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR</b>					
<b>i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)</b>					
Propuestas recibidas	100,0		96,0	100,0	
Plazo de vencimiento	230,0		96,0	335,2	
Tasas de interés: Mínima	185 d		547 d	364 d	
Máxima	3,20		3,40	3,25	
Promedio	3,30		3,50	3,25	
Saldo	3,27		3,46	3,28	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 09 de Abril de 2015	18 555,3	18 555,3	18 551,3	17 331,3	17 931,3
Vencimientos de CD BCRP entre el 16 y el 20 de Marzo de 2015		820,0	820,0	2 210,1	2 210,1
<b>ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)</b>					
Propuestas recibidas	1 000,0	1 900,0	1 000,0	1 060,0	1 300,0
Plazo de vencimiento	1 760,0	2 134,0	2 100,0	1 100,0	1 660,0
Tasas de interés: Mínima	7 d	1 d	7 d	1 d	1 d
Máxima	3,71	3,42	3,31	3,25	3,28
Promedio	3,71	3,61	3,71	3,37	3,51
Saldo	3,71	3,49	3,45	3,34	3,47
Próximo vencimiento de Repo el 16 de Marzo de 2015	4 000,0	4 200,0	4 160,0	3 800,0	4 400,0
Vencimientos de REPO entre el 16 y el 20 de Marzo de 2015		1 100,0	1 060,0	700,0	2 300,0
<b>iv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 18 de Marzo de 2015	2 235,0	2 235,0	2 235,0	2 235,0	2 235,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 16 y el 20 de Marzo de 2015		300,0	300,0	300,0	300,0
<b>v. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo el 21 de Setiembre de 2015	8 600,0	8 600,0	8 600,0	8 600,0	8 600,0
Vencimientos de REPO entre el 16 y el 20 de Marzo de 2015		300,0	300,0	300,0	300,0
<b>vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo el 17 de Enero de 2017	1 700,0	1 700,0	1 700,0	1 700,0	1 700,0
Vencimientos de REPO entre el 16 y el 20 de Marzo de 2015		300,0	300,0	300,0	300,0
<b>vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo el 26 de Enero de 2018	700,0	700,0	700,0	700,0	700,0
Vencimientos de REPO entre el 16 y el 20 de Marzo de 2015		200,0	200,0	200,0	200,0
<b>viii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP</b>					
Propuestas recibidas	300,0	300,0	600,0	300,0	600,0
Plazo de vencimiento	1 150,0	510,0	1 050,0	1 050,0	1 130,0
Tasas de interés: Mínima	35 d	64 d	64 d	65 d	67 d
Máxima	-1,98	-2,02	-2,17	-1,85	-1,56
Promedio	-1,98	-1,77	-1,56	-0,51	-1,17
Saldo	-1,98	-1,96	-2,02	-1,10	-0,83
Próximo vencimiento de SC-Venta el 16 de Marzo de 2015	21 698,5	22 298,5	22 298,5	22 300,1	22 601,7
Vencimientos de SC-Venta entre el 16 y el 20 de Marzo de 2015		1 200,0	588,4	600,0	600,0
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</b>					
<b>i. Compras (millones de US\$)</b>					
Compras	-641,2	-437,0	0,0	-629,3	0,0
<b>ii. Ventas (millones de US\$)</b>					
Ventas	207,0	141,0	203,0	203,0	203,0
<b>c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</b>					
Compras	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Ventas	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</b>					
Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Compras de BTP					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>3 129,1</b>	<b>2 949,0</b>	<b>2 878,1</b>	<b>2 216,9</b>	<b>2 991,0</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
<b>a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</b>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0113%	0,0113%	0,0113%	0,0113%	0,0113%
Comisión (tasa efectiva diaria) fuera de subasta					
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
<b>b. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</b>					
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
<b>c. Depósitos Overnight en moneda nacional</b>					
Tasa de interés	164,4	161,9	149,8	153,2	152,5
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>2 864,7</b>	<b>2 797,1</b>	<b>2 728,3</b>	<b>2 065,7</b>	<b>2 748,5</b>
<b>a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)</b>	8 951,2	8 932,4	8 906,4	8 798,1	8 585,2
<b>b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	9,3	9,3	9,3	9,2	9,1
<b>c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)</b>	3 333,0	3 278,5	3 262,5	3 154,2	2 941,3
<b>d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	3,4	3,4	3,4	3,3	3,3
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
<b>a. Operaciones a la vista en moneda nacional</b>					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	198,0	85,0	381,0	568,0	464,0
<b>b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</b>	3,25/3,50/3,30	3,30/3,30/3,30	3,35/3,35/3,35	3,35/3,40/3,36	3,35/3,35/3,35
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	20,0	30,0	102,0	110,0	110,0
<b>c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</b>	0,0	0,0	20,0	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			10,0 / 3,27		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>					
<b>Flujo de la posición global = a + b.i + c.i + e + f</b>	-3,4	-100,2	-38,6	-76,7	-134,0
<b>Flujo de la posición contable = a + b.ii + c.ii + e + f</b>	-103,8	-157,2	-60,9	-53,7	64,7
<b>a. Mercado spot con el público</b>					
Compras	-264,3	-310,2	-309,6	-191,6	-290,2
Ventas	688,8	526,4	518,3	689,2	592,3
<b>b. Compras forward al público (con y sin entrega)</b>					
Pactadas	853,0	836,6	827,5	859,7	882,4
Vencidas	1,7	127,2	156,2	69,6	126,0
<b>c. Ventas forward al público (con y sin entrega)</b>					
Pactadas	185,8	160,4	150,1	239,9	188,5
Vencidas	387,6	62,2	246,6	35,7	40,0
<b>d. Operaciones cambiarias interbancarias</b>					
Al contado	237,4	182,3	342,8	329,5	217,8
A futuro	596,0	278,2	487,3	428,0	288,5
<b>e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</b>					
Compras	96,3	135,9	318,3	226,4	180,6
Ventas	236,0	181,9	340,1	326,6	216,2
<b>f. Operaciones netas con otras instituciones financieras</b>					
Compras	140,7	46,0	21,8	100,1	35,6
Ventas	599,0	31,1	312,1	-16,7	186,7
<b>g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</b>					
Tasa de interés					
<b>Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)</b>	3,1004	3,0981	3,0995	3,0983	3,0995