

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	16 Marzo 15	17 Marzo 15	18 Marzo 15	19 Marzo 15	20 Marzo 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	199,4	37,8	843,3	636,3	503,1
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	100,0		62,0	50,0	
Plazo de vencimiento	205,6		62,0	242,8	
Tasas de interés: Mínima	178,3		540,4	357,4	
Máxima	3,19		3,36	3,25	
Promedio	3,21		3,30	3,29	
Saldo	3,21		3,44	3,30	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 09 de Abril de 2015	18.031,3	18.031,3	18.093,3	18.143,3	18.143,3
Vencimientos de CD BCRP entre el 20 de Marzo de 2015			2.210,1		2.210,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1.000,0	1.650,0	500,0	500,1	1.000,0
Plazo de vencimiento	2.330,0	2.330,0	1.082,0	1.100,0	800,0
Tasas de interés: Mínima	7,4	1,4	7,4	1,4	3,4
Máxima	3,71	3,65	3,81	3,25	3,28
Promedio	3,71	3,91	3,87	3,48	3,38
Saldo	3,71	3,90	3,86	3,33	3,32
Próximo vencimiento de Repo el 20 de Marzo de 2015	4.750,0	5.107,0	4.700,1	4.300,0	4.400,0
Vencimientos de Repo el 20 de Marzo de 2015			2.100,1		2.000,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2.235,0	2.235,0	1.935,0	1.935,0	1.935,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 1 de Abril de 2015			150,0		150,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables el 20 de Marzo de 2015			0,0		0,0
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	8.600,0	8.600,0
Próximo vencimiento de Repo el 21 de Setiembre de 2015			300,0		300,0
Vencimientos de Repo el 20 de Marzo de 2015			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	1.700,0	1.700,0	1.700,0	1.700,0	2.200,0
Próximo vencimiento de Repo el 17 de Enero de 2017			300,0		300,0
Vencimientos de Repo el 20 de Marzo de 2015			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	1.100,0	1.100,0	1.100,0	1.100,0	1.100,0
Próximo vencimiento de Repo el 26 de Enero de 2018			200,0		200,0
Vencimientos de Repo el 20 de Marzo de 2015			0,0		0,0
viii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	300,0		300,0	180,0	
Plazo de vencimiento	880,0		1.080,0	440,0	
Tasas de interés: Mínima	65,4		63,4	64,4	
Máxima	-0,51		-0,61	0,01	
Promedio	0,01		-0,61	0,15	
Saldo	-0,06		-0,61	0,06	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 20 de Marzo de 2015	22.300,1	22.000,0	21.880,0	21.580,0	21.580,0
Vencimientos de SC-Venta el 20 de Marzo de 2015			300,0		300,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2.749,4	3.044,8	2.881,4	2.286,3	2.803,1
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%	0,0113%	0,0114%	0,0114%
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
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	160,9	159,7	458,3	155,3	804,3
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%
d. Depósitos Overnight 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	2.588,5	2.885,1	2.423,1	2.131,0	1.998,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	8.885,5	8.724,7	8.631,3	8.580,2	0,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,0	9,1	9,0	8,9	9,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	3.082,6	3.009,9	2.977,3	2.926,2	20,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,2	3,2	3,1	3,0	2,1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	334,0	344,2	734,0	859,0	843,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,35/3,35/3,35	3,40/3,50/3,40	3,25/3,40/3,32	3,25/3,35/3,33	3,25/3,25/3,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	96,0	90,0	0,0	8,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,20/0,19	0,15/0,20/0,19	0,15/0,15/0,15	0,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	153,9	81,8	72,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		73,9 / 3,20	3,4 / 3,23		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			71,8 / 3,23		
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	13 Marzo 15	16 Marzo 15	17 Marzo 15	18 Marzo 15	19 Marzo 15
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	85,2	-140,4	-199,3	70,3	65,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	114,0	85,5	-21,5	-62,9	45,7
a. Mercado spot con el público	-101,0	-170,6	-94,7	-91,8	-139,7
i. Compras	664,7	600,1	561,9	579,9	475,7
ii. (c) Ventas	765,7	770,6	656,6	671,7	615,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	78,8	-354,0	-51,4	9,1	-40,8
i. Pactadas	220,9	191,0	92,3	170,1	236,3
ii. (c) Vencidas	142,1	545,0	143,6	161,0	277,2
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	217,2	-235,3	25,9	-169,6	-160,5
i. Pactadas	328,8	385,5	242,1	111,4	121,1
ii. (c) Vencidas	111,7	618,8	216,2	281,0	281,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	528,8	387,2	324,0	482,0	550,5
ii. A futuro	115,0	10,0	90,0	0,0	5,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	55,6	329,7	145,7	249,1	189,4
i. Compras	108,4	613,7	216,1	268,1	278,5
ii. (c) Ventas	52,8	284,0	70,4	19,1	89,1
f. Operaciones spot con otras instituciones financieras	218,5	-105,2	-100,5	-145,8	-99,7
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,1004	3,0970	3,0959	3,0984	3,0958
(*) Datos preliminares					