

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	23 Marzo 15	24 Marzo 15	25 Marzo 15	26 Marzo 15	27 Marzo 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	864,9	597,8	984,4	1 067,9	719,8
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 BCR (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	50,0		50,0	50,0	
Plazo de vencimiento	171 d		533 d	350 d	
Tasas de interés: Mínima	3,19		3,45	3,35	
Máxima	3,35		3,60	3,39	
Promedio	3,24		3,57	3,38	
Saldo	18 193,3	18 193,3	18 243,3	18 243,3	18 293,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 9 de Abril de 2015			2 210,1	2 210,1	2 210,1
Vencimientos de CD BCRP del 30 de Marzo al 1 de Abril de 2015			0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1 000,1 300,0	500,0 470,0	600,0	500,0 500,0	500,0
Plazo de vencimiento	1 d 92 d	1 150,0 470,0	950,0	1 600,0 500,0	593,3
Tasas de interés: Mínima	3,28 3,76	1 d 1 d	1,4	1 d 1 d	3,4
Máxima	3,34 3,88	3,90 3,26	3,33	4,01 3,61	3,31
Promedio	3,29 3,82	3,90 3,32	3,36	4,03 3,61	3,38
Saldo	3 700,1	3 170,0	3 300,0	3 700,0	2 900,0
Próximo vencimiento de Repo el 30 de Marzo de 2015			600,0	1 300,0	500,0
Vencimientos de REPO del 30 de Marzo al 1 de Abril de 2015			1 400,0	1 300,0	500,0
iii. 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	1 935,0	1 935,0	1 935,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 1 de Abril de 2015			150,0	150,0	150,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables del 30 de Marzo al 1 de abril 2015			0,0	0,0	150,0
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	300,0
Vencimientos de REPO del 30 de Marzo al 1 de Abril de 2015			0,0	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	2 200,0	2 200,0	2 200,0	2 200,0	2 600,0
Próximo vencimiento de Repo el 17 de Enero de 2017			300,0	300,0	300,0
Vencimientos de REPO del 30 de Marzo al 1 de abril 2015			0,0	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	1 500,0
Próximo vencimiento de Repo el 26 de Enero de 2018			0,0	200,0	200,0
Vencimientos de REPO del 30 de Marzo al 1 de abril 2015			0,0	0,0	0,0
viii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	20 980,0	20 680,0	20 980,0	20 680,0	21 280,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de Marzo de 2015			300,0	300,0	300,0
Vencimientos de SC-Venta del 30 de Marzo al 1 de abril 2015			0,0	0,0	1 200,0
ix. 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. Tipo de cambio promedio					
iii. Ventas (millones de US\$)					
iv. 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	2 115,0	1 567,8	1 534,4	2 017,9	1 219,8
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%	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 regularización monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	693,1	534,8	633,1	1 043,7	586,9
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	1 421,9	1 033,0	1 601,3	1 174,2	632,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	8 434,1	8 434,1	8 348,3	8 256,6	8 197,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,8	8,8	8,7	8,6	8,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 973,8	2 739,8	2 694,3	2 611,2	2 552,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,9	2,9	2,8	2,7	2,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	753,0	1 115,0	1 230,0	1 401,6	1 410,0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	3,25/3,30/3,25	3,25/3,25/3,25	3,25/3,30/3,25	3,25/3,30/3,40	3,25/3,50/3,41
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,0	20,0	15,0	30,0	0,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	60,0	201,3	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			9,0 / 3,27		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			9,0 / 3,27		
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	20 Marzo 15	23 Marzo 15	24 Marzo 15	25 Marzo 15	26 Marzo 15
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-114,3	-193,8	83,5	81,6	30,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-12,4	-117,2	-191,6	-39,3	-0,7
a. Mercado spot con el público	-94,5	-219,8	-334,4	-148,0	-29,3
i. Compras	467,1	435,8	600,7	582,3	743,5
ii. (-) Ventas	551,6	654,6	935,1	731,3	836,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-130,4	-107,8	179,5	46,3	213,7
i. Paquetadas	56,7	107,6	372,5	119,5	346,2
ii. (-) Vencidas	187,2	215,4	193,0	167,8	132,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-128,1	-130,8	-173,3	-73,3	63,2
i. Paquetadas	80,9	116,9	113,4	113,0	108,4
ii. (-) Vencidas	219,1	247,7	286,6	186,2	25,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	794,2	833,0	813,5	1047,2	963,8
ii. A futuro	85,0	0,0	50,0	85,0	3,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	116,1	184,2	233,4	128,1	15,3
i. Compras	206,3	246,2	279,2	185,3	18,9
ii. (-) Ventas	90,2	62,0	46,8	57,2	3,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-111,8	-149,8	-96,5	97,9	-129,2
g. Crédito por regularización monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,0873	3,0776	3,0714	3,0652	3,0806
h. Tasas primarias					