

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	06 Abril 15	07 Abril 15	08 Abril 15	09 Abril 15	10 Abril 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	719,9	352,7	230,8	1 938,4	2 347,6
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR	50,0		50,0		
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	170,3		170,2		
Propuestas recibidas	192 d		547 d		
Plazo de vencimiento	3,24		3,48		
Tasas de interés: Mínima	3,25		3,49		
Máxima	3,25		3,33		
Promedio	18 443,3	18 443,3	18 443,3		16 333,2
Saldo			2 210,1		
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de Abril de 2015			1 100,0		1 100,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 13 y el 17 de Abril de 2015			2 210,1		1 100,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1 500,0 1 550,0	250,0 2 000,0	1 000,0 1 400,0	800,0	
Propuestas recibidas	2 470,0 1 550,0	250,0 2 178,0	2 010,0 1 600,0	800,0	
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	
Tasas de interés: Mínima	3,51 3,25	3,25 3,25	3,33 3,31	3,33	
Máxima	3,51 3,65	3,45 3,40	3,40 3,31	3,33	
Promedio	3,51 3,31	3,35 3,33	3,36 3,31	3,33	
Saldo	5 450,0	4 150,0	4 300,0	2 700,0	1 900,0
Próximo vencimiento de Repo el 18 de Mayo de 2015			2 400,0	800,0	800,0
Vencimientos de REPO entre el 13 y el 17 de Abril de 2015			2 400,0	800,0	0,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Resguistables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 485,0	1 485,0	1 485,0	1 230,0	930,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 13 de Abril de 2015				300,0	300,0
Vencimientos de Depósitos Resguistables entre el 13 y el 17 de abril 2015				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	8 600,0	8 600,0	8 600,0	8 600,0	8 600,0
Próximo vencimiento de Repo el 21 de Setiembre de 2015					300,0
Vencimientos de REPO entre el 13 y el 17 de Abril de 2015					0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 700,0	2 700,0	2 700,0	2 700,0	2 700,0
Próximo vencimiento de Repo el 17 de Enero de 2017					300,0
Vencimientos de REPO entre el 13 y el 17 de abril 2015					0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 500,0		1 500,0	1 500,0	2 000,0
Próximo vencimiento de Repo el 26 de Enero de 2015	200,0	1 500,0	200,0	200,0	200,0
Vencimientos de REPO entre el 13 y el 17 de abril 2015	0,0		0,0	0,0	0,0
viii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300,0 300,0	300,0 300,0 300,0	600,0	600,0	600,0
Propuestas recibidas	1 023,0 860,0	1 560,0 1 160,0 970,0 730,0	1 860,0 1 240,0	1 430,0 1 180,0 760,0	1 420,0
Plazo de vencimiento	63 d 64 d	62 d 64 d 66 d 66 d	63 d 64 d	64 d 68 d	69 d
Tasas de interés: Mínima	-1,02 -1,01	-1,25 -1,50 -1,50 -0,76	-1,50 -1,33	-1,56 -1,36 -1,35	-1,56
Máxima	-0,88 -0,87	-1,17 -1,33 -1,36 -0,87	-1,20 -0,72	-1,27 -0,98	-1,28
Promedio	-0,98 -0,97	-1,23 -1,45 -1,40 -0,72	-1,34 -0,87	-1,44 -1,25 -0,99	-1,39
Saldo	21 480,1	22 080,1	22 680,1	23 580,1	23 880,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de Abril de 2015					900,0
Vencimientos de SC-Venta entre el 13 y el 17 de abril 2015					3 600,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	-34,3
ii. Tipo de cambio promedio					
iii. Ventas (millones de US\$)					11,0
iv. Tipo de cambio promedio					3,1205
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					0,0
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	3 719,9	2 602,7	2 580,8	2 688,4	2 313,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps): Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0114%	0,0113%	0,0113%	0,0113%	0,0113%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
Tasa de interés	151,0	189,8	149,4	603,6	612,8
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	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	3 568,9	2 412,9	2 431,4	2 084,8	1 700,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	7 345,5	9 570,4	9 541,9	9 333,9	9 147,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,3	9,9	9,9	9,7	9,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	3 970,6	3 903,6	3 719,6	3 512,2	3 331,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,4	3,9	3,9	3,6	3,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	278,0	842,0	446,0	710,0	1 275,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,35/3,35/3,35	3,25/3,40/3,38	3,25/3,35/3,30	3,25/3,35/3,25	3,25/3,35/3,29
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	17,0	0,0	0,0	0,0	174,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15	0,0	0,0	0,0	0,15/0,15/0,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,5	0,0	0,0	46,0	131,8
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\$)					
Flujo de la posición global = a + b + c + e + f	-112,0	-49,4	70,5	49,5	96,1
Flujo de la posición contable = a + b + c + e + f	-81,9	-158,7	0,1	-97,5	18,4
a. Mercado spot con el público	-215,7	-319,0	-230,8	-195,3	-159,3
i. Compras	673,9	528,0	543,3	507,7	618,4
ii. (f) Ventas	889,6	845,0	774,2	702,9	777,7
iii. (f) Ventas	96,5	-28,5	19,8	29,4	-216,6
iv. Pactadas	211,7	340,5	324,8	302,9	294,2
v. (f) Ventas	308,2	369,2	305,0	274,5	510,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-67,5	-22,9	135,9	70,6	52,1
i. Pactadas	263,8	132,0	310,6	488,9	663,6
ii. (f) Ventas	331,2	154,9	174,8	418,3	611,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	388,2	331,4	300,0	493,8	774,2
ii. A futuro	25,0	30,0	10,0	50,0	10,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	219,8	50,2	100,8	241,6	362,8
i. Compras	329,3	60,1	161,0	410,9	608,9
ii. (f) Ventas	109,6	9,9	60,2	169,3	246,2
f. Operaciones reales con otras instituciones financieras	-63,9	-39,1	186,4	189,1	202,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datarec)	3,0944	3,0918	3,0991	3,1040	3,1147
(*) Datos preliminares					