

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	27 Abril 15	28 Abril 15	29 Abril 15	30 Abril 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	514,7	567,2	502,6	359,5
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	50,0		50,0	21,4
Plazo de vencimiento	274,1		60,0	21,4
Tasas de interés: Mínima	171 d		526 d	343 d
Máxima	3,14		3,32	3,59
Promedio	3,15		3,59	2,91
Saldo	3,14		3,52	3,39
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de Mayo de 2015	15 383,2	15 383,2	15 433,2	15 454,6
Vencimientos de CD BCRP del 4 al 8 de Mayo de 2015		1 675,1		1 675,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2 400,0	1 000,0 1 400,0	1 000,0 470,0	1 000,0 500,0
Propuestas recibidas		2 325,0 1 410,0	1 440,0 470,0	2 545,0 1 400,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	4 d 4 d
Tasas de interés: Mínima		4,07 3,75	3,57 3,25	3,43 3,76
Máxima		4,20 4,15	3,75 3,25	3,69 5,30
Promedio		4,12 4,07	3,60 3,25	3,45 4,52
Saldo	4 300,0	4 300,0	3 370,0	3 400,0
Próximo vencimiento de Repo el 4 de Mayo de 2015		2 400,0		1 500,0
Vencimientos de REPO del 4 al 8 de Mayo de 2015		2 400,0		1 500,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 4 de Abril de 2015				
Vencimientos de Depósitos a Plazo entre el 28 y el 30 de Abril de 2015				
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 7 de Mayo de 2015	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables del 4 al 8 de mayo 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	9 500,0	9 500,0	9 500,0	9 500,0
Próximo vencimiento de Repo el 21 de Setiembre de 2015		300,0		300,0
Vencimientos de REPO del 4 al 8 de Mayo 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	3 300,0	3 300,0	3 300,0	3 900,0
Próximo vencimiento de Repo el 17 de Enero de 2017		300,0		300,0
Vencimientos de REPO del 4 al 8 de Mayo 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	2 150,0	2 150,0	2 150,0	2 150,0
Próximo vencimiento de Repo el 27 de Enero de 2018		200,0		200,0
Vencimientos de REPO del 4 al 8 de mayo 2015		0,0		0,0
viii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	100,0 1 85,0	300,0	300,0	300,0 300,0
Propuestas recibidas	685,0 635,0	640,0	560,0	920,0 960,0
Plazo de vencimiento	70 d 71 d	69 d	69 d	70 d 71 d
Tasas de interés: Mínima	-0,25 -0,25	-0,50	-0,1	-0,21 -0,36
Máxima	-0,25 -0,10	-0,05	0,0	-0,15 -0,31
Promedio	-0,25 -0,20	-0,33	0,0	-0,34
Saldo	25 865,0	25 865,0	25 865,1	26 165,1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 4 de Mayo de 2015		300,0		600,0
Vencimientos de SC-Venta del 4 al 8 de mayo 2015		900,0		3 000,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)	-225,7	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US\$)	72,0			
Tipo de cambio promedio	3,1350			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)		0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público				
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
ii. Compras de BTP				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2 638,9	2 967,2	1 922,6	2 438,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0112%	0,0112%	0,0113%	0,0108%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	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%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 696,3	1 946,5	1 186,5	426,4
Tasa de interés	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	942,6	1 020,7	736,1	2 011,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	7 817,3	7 876,6	7 731,2	7 722,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,1	8,2	8,0	8,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 120,1	2 080,9	1 946,7	1 948,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,1	2,2	2,0	2,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	937,0	588,0	807,0	494,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,804 / 0,54 / 0,0	3,254 / 0,93 / 0,0	3,253 / 0,93 / 0,0	3,253 / 0,53 / 0,0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	16,0	20,0	0,0	37,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	16,0 / 3,15			30,0 / 3,15
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	24 Abril 15	27 Abril 15	28 Abril 15	29 Abril 15
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	81,9	-114,4	-117,0	64,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	170,1	67,7	-163,5	-17,3
a. Mercado spot con el público	-38,4	-233,3	-244,9	-86,5
i. Compras	395,5	281,4	278,5	343,5
ii. (-) Ventas	433,9	404,7	523,4	429,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	37,6	-57,5	-56,9	75,4
i. Pactadas	100,2	189,4	271,4	259,8
ii. (-) Vencidas	62,6	246,9	328,3	184,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	121,9	19,3	-106,4	-9,4
i. Pactadas	133,8	241,4	261,2	323,1
ii. (-) Vencidas	11,9	222,1	367,6	332,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	325,5	605,0	795,6	788,7
ii. A futuro	30,0	15,0	7,0	40,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-6,0	111,2	206,9	257,3
i. Compras	9,0	119,8	357,6	331,9
ii. (-) Ventas	15,0	8,6	150,7	74,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	159,9	-50,3	-89,3	-42,8
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,1339	3,1344	3,1262	3,1193
(*) Datos preliminares				