

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	13 Abril 2016	14 Abril	15 Abril	18 Abril	19 Abril
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	5 766,3	5 898,8	3 579,4	2 845,4	2 312,5
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	30 300 300	30 500 500	500 300	30 200	200 200
Plazo de vencimiento	209 775 867	220 1260 1015	941 873	170 602	339 310
Tasas de interés	547 d 547 d 358 d	364 d 364 d 539 d	181 d 538 d	178 d 360 d	359 d 534 d
Mínima	4,97 4,85 4,80	4,69 4,68 4,75	4,30 4,80	4,46 4,60	4,50 4,77
Máxima	4,99 4,90 4,85	4,71 4,70 4,90	4,60 4,88	4,55 4,60	4,90 5,10
Promedio	4,98 4,90 4,83	4,70 4,70 4,84	4,45 4,85	4,51 4,60	4,67 4,87
Saldo	<u>15 675,2</u>	<u>15 505,2</u>	<u>16 305,2</u>	<u>16 535,2</u>	<u>16 935,2</u>
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Saldo	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Saldo	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
Saldo	160,0	160,0	160,0	160,0	160,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	2 000,0	1 999,9	700,0	300,0	300,0
Plazo de vencimiento	3 065,9	2 872,7	1 958,8	1 090,1	1 090,1
Tasas de interés	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Mínima	4,10	4,10	4,05	3,85	3,85
Máxima	4,22	4,20	4,10	4,03	4,03
Promedio	4,19	4,19	4,10	3,97	3,97
Saldo	<u>2 000,0</u>	<u>1 999,9</u>	<u>700,0</u>	<u>300,0</u>	<u>300,0</u>
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 20 de abril de 2016					
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 20 y el 22 de Abril de 2016					
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Saldo	2 500,0	2 500,0	2 500,0	2 500,0	2 500,0
vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Saldo	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	55,0	231,0	120,0	120,0	120,0
Plazo de vencimiento	91 d	91 d	91 d	91 d	91 d
Tasas de interés	0,74	0,74	0,75	0,75	0,75
Mínima	0,74	0,74	0,74	0,74	0,75
Promedio	0,74	0,74	0,74	0,74	0,75
Saldo	<u>6 350,0</u>	<u>6 285,0</u>	<u>6 285,0</u>	<u>5 996,0</u>	<u>5 816,0</u>
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Saldo	16 200,0	16 200,0	15 600,0	15 600,0	15 600,0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Saldo	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Saldo	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	190,0	95,0	330,0	334,9	334,9
Plazo de vencimiento	229,0	256,0	330,0	376,0	376,0
Tasas de interés	91 d	91 d	91 d	91 d	91 d
Mínima	0,40	0,65	0,50	0,49	0,49
Máxima	0,74	0,69	0,75	0,75	0,75
Promedio	0,59	0,68	0,70	0,71	0,71
Saldo	<u>23 682,8</u>	<u>23 493,8</u>	<u>22 099,2</u>	<u>21 350,4</u>	<u>20 862,9</u>
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 081,3	2 868,9	2 779,4	1 684,4	1 492,5
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0138%	0,0138%	0,0128%	0,0138%	0,0139%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	147,1	930,5	391,6	514,3	514,3
Tasa de interés	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	2 934,2	2 856,9	1 848,9	1 292,8	978,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 295,8	4 295,8	4 295,8	4 295,8	4 295,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	7,8	7,8	7,7	7,6	7,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 875,1	2 879,7	2 878,1	2 809,5	2 618,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)	2,8	2,8	2,7	2,6	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 619,0	1 687,0	1 693,0	1 770,0	1 727,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	311,0	178,0	178,0	168,0	182,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,38 / 0,43 / 0,39	0,38 / 0,38 / 0,38	0,38 / 0,38 / 0,38	0,38 / 0,38 / 0,38	0,38 / 0,38 / 0,38
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	40,0	119,0	118,0	130,0	226,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	8,0 / 5,25	23 / 4,85	23 / 4,70	40 / 4,80	186 / 4,60
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)		96 / 4,90	20 / 4,80	80 / 4,70	40 / 4,80
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	12 abril 2016	13 abril	14 abril	15 abril	19 abril
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	30,3	-21,9	147,2	-239,0	1,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-138,1	-120,4	60,7	93,3	-31,1
a. Mercado spot con el público	-28,6	-1,1	73,9	69,4	59,0
i. Compras	216,4	268,3	300,9	336,5	249,5
ii. (-) Ventas	245,0	269,4	227,0	267,1	190,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	76,2	-30,7	-21,9	-4,7	100,4
i. Pactadas	155,7	220,0	158,3	100,6	146,3
ii. (-) Vencidas	79,4	250,7	180,1	105,3	45,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-162,9	-189,8	-156,4	-67,8	-48,3
i. Pactadas	68,6	174,9	231,9	154,7	260,6
ii. (-) Vencidas	231,5	364,7	388,2	222,5	308,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1026,1	766,6	795,7	955,4	945,5
ii. A futuro	15,0	5,0	0,0	5,0	5,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	161,7	120,8	212,6	132,4	222,8
i. Compras	228,5	364,1	384,9	213,2	258,5
ii. (-) Ventas	66,9	243,3	172,3	80,8	35,8
f. Efecto de Opciones	-1,0	-5,2	6,9	-0,8	17,8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-188,8	-181,4	-72,6	-38,0	-184,1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2696	3,2697	3,2709	3,2766	3,2491
(*) Datos preliminares					

d. = día(s) s. = semana(s) m. = mes(es) a. = año(s)

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera.

