

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

(Millones de Nuevos Soles)

	24 Noviembre 14	25 Noviembre 14	26 Noviembre 14	27 Noviembre 14	28 Noviembre 14
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>1 882,4</b>	<b>1 017,8</b>	<b>1 707,6</b>	<b>1 850,9</b>	<b>1 285,1</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	100,0		100,0	100,0	
Plazo de vencimiento	305,3		221,0	289,0	
Tasas de interés Mínima	171,4		533,4	350,4	
Máxima	3,31		3,41	3,45	
Promedio	3,50		3,41	3,59	
Saldo	3,46		3,41	3,57	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de Diciembre de 2014	15 435,1	15 435,1	15 535,1	15 635,1	15 635,1
Vencimientos de CD BCRP entre el 1 y el 5 de Diciembre de 2014			1 000,0	1 000,0	1 000,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2 000,0	446,0	1 130,0	600,0	900,0
Propuestas recibidas	3 672,0	446,0	1 130,0	1 095,0	950,0
Plazo de vencimiento	1,4	1,4	1,4	1,4	3,4
Tasas de interés Mínima	3,53	3,50	3,50	3,61	3,62
Máxima	3,70	3,58	3,61	3,71	4,01
Promedio	3,55	3,50	3,51	3,68	3,82
Saldo	4 061,0	1 745,0	1 215,0	1 815,0	1 515,0
Próximo vencimiento de Repo el 1 de Diciembre de 2014			600,0	1 000,0	900,0
Vencimientos de Repo entre el 1 y el 5 de Diciembre de 2014			600,0	1 000,0	900,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	60,0				
Propuestas recibidas	60,0				
Plazo de vencimiento	63 d				
Tasas de interés Mínima	0,12				
Máxima	0,15				
Promedio	0,13				
Saldo	3 285,0	2 955,0	2 555,0	2 555,0	2 740,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 1 de Diciembre de 2014			115,0	115,0	300,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 1 y el 5 de Diciembre de 2014			115,0	115,0	915,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 591,5	4 591,5	4 591,5	4 591,5	5 091,5
Próximo vencimiento de Repo el 4 de Diciembre de 2014			300,0	300,0	300,0
Vencimientos de REPO entre el 1 y el 5 de Diciembre de 2014			0,0	0,0	600,0
viii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300,0				
Propuestas recibidas	770,0				
Plazo de vencimiento	63 d				
Tasas de interés Mínima	0,00				
Máxima	0,05				
Promedio	0,02				
Saldo	12 059,9	12 059,9	12 059,9	12 059,9	12 659,8
Próximo vencimiento de SC-Venta (5 de Diciembre de 2014)			300,0	300,0	300,0
Vencimientos de SC-Venta entre el 1 y el 5 de Diciembre de 2014			0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>4 168,4</b>	<b>2 147,8</b>	<b>2 207,6</b>	<b>2 750,9</b>	<b>2 385,1</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0120%	0,0121%	0,0121%	0,0121%	0,0121%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
Tasa de interés	663,3	528,5	520,5	508,7	629,7
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,30%	2,30%	2,30%	2,30%	2,30%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>3 505,1</b>	<b>1 619,3</b>	<b>1 687,1</b>	<b>2 242,2</b>	<b>1 755,4</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 257,9	10 152,1	10 040,4	10 100,0	9 977,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,9	10,8	10,6	10,7	10,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	4 712,9	4 590,1	4 477,5	4 518,7	4 396,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,0	4,9	4,7	4,8	4,7
<b>6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	826,5	1 324,5	1 246,5	1 069,0	1 427,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,55/3,50	3,50/3,50/3,50	3,50/3,65/3,51	3,50/3,60/3,59	3,60/3,75/3,65
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	5,0	0,0	15,0	30,0	30,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,150/0,150/15		0,100/0,150/14	0,100/0,150/14	0,100/0,150/15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	15,0	55,0	5,0	102,0 / 3,40	33,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		20,0 / 3,30			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>21 Noviembre</b>	<b>24 Noviembre</b>	<b>25 Noviembre</b>	<b>26 Noviembre</b>	<b>27 Noviembre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-122,7	-0,4	84,4	-97,7	41,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-73,5	-236,9	-18,9	-126,6	125,1
a. Mercado spot con el público	-155,1	-333,7	-77,0	-56,2	29,6
i. Compras	286,8	167,6	266,1	296,6	256,0
ii. (-) Ventas	441,8	501,4	343,1	354,7	226,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	4,3	24,0	-356,5	59,0	205,9
i. Pactadas	291,3	305,4	147,2	187,3	315,0
ii. (-) Vencidas	287,0	281,5	503,7	128,3	109,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	144,4	-109,7	-459,9	30,0	289,4
i. Pactadas	285,8	211,7	190,8	131,9	300,4
ii. (-) Vencidas	141,4	321,4	650,7	101,9	11,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1265,7	643,1	533,2	668,4	144,7
ii. A futuro	83,0	45,0	108,0	103,0	41,7
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	43,1	225,3	319,6	42,7	7,6
i. Compras	140,0	312,8	649,6	73,5	7,8
ii. (-) Ventas	96,9	87,5	330,0	30,8	0,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-16,3	14,3	-114,5	-139,6	-10,1
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,9165	2,9167	2,9158	2,9124	2,9116
(*) Datos preliminares					