BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	15 Diciembre 14	16 Diciembre 14	17 Diciembre 14	18 Diciembre 14	19 Diciembre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	**1 320,3**	**1 382,0**	**1 095,7**	**1 062,5**	**2 258,4**
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)	100,0		67,0	78,0	
Propuestas recibidas	242,0		67,0	218,0	
Plazo de vencimiento	178 d		540 d	357 d	
Tasas de interés Mínima	3,25		3,39	3,40	
Máxima	3,41		3,60	3,75	
Promedio	3,38		3,44	3,64	
Saldo	15 235,1	15 235,1	15 302,1	15 380,1	15 380,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 08 de Enero de 2015			1 649,8	1 649,8	1 649,8
Vencimientos de CD BCRP entre el 22 y el 26 de Diciembre de 2014			0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2 674,0	2 600,0	2 600,0	1 000,0 1 000,0	1 000,0
Propuestas recibidas	2 674,0	2 671,5	2 643,0	1 887,0 1 612,0	1 377,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	8 d 1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	3,50	3,50	3,51	3,81 3,53	3,61
Máxima	3,91	3,70	3,68	3,81 3,93	3,85
Promedio	3,59	3,56	3,56	3,81 3,64	3,67
Saldo	3 289,0	3 215,0	3 215,0	2 615,0	2 615,0
Próximo vencimiento de Repo el 22 de Diciembre de 2014			2 600,0	1 000,0	1 000,0
Vencimientos de REPO entre el 22 y el 26 de Diciembre de 2014			2 600,0	1 000,0	
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)		300,0			
Propuestas recibidas		Desierta			
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 495,0	2 495,0	2 495,0	2 495,0	2 495,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 29 de Diciembre de 2014			205,0	205,0	205,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 22 y el 26 de Diciembre de 2014			0,0	0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera	400,0	400,0	400,0	500,0 500,0	400,0
Propuestas recibidas	1550,6	1544,5	1556,4	1 772,4 1 368,8	1 130,0
Plazo de vencimiento	365 d	365 d	365 d	365 d 365 d	367 d
Tasas de interés Mínima	4,30	4,32	4,25	4,25 3,95	3,80
Máxima	4,60	4,45	4,51	4,40 4,26	3,90
Promedio	4,38	4,36	4,34	4,27 4,05	3,85
Saldo	5 091,5	5 491,5	5 891,5	6 891,5	7 291,5
Próximo vencimiento de Repo el 30 de Diciembre de 2014			391,5	391,5	391,5
Vencimiento de REPO entre el 22 y el 26 de Diciembre de 2014			0,0	0,0	0,0
vii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		300,0 300,0			300,1
Propuestas recibidas		520,0 628,4			1100,0
Plazo de vencimiento		90 d 90 d			62 d
Tasas de interés Mínima		-0,20 -0,22			-0,51
Máxima		-0,17 -0,18			-0,51
Promedio		-0,20 -0,21			-0,51
Saldo	15 428,0	15 728,0	15 728,0	15 728,0	16 028,1
Próximo vencimiento de SC-Venta (23 de Diciembre de 2014)			230,0	230,0	230,0
Vencimiento de SC-Venta entre el 22 y el 26 de Diciembre de 2014			0,0	0,0	830,1
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	-297,0	0,00	0,00	0,00
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)		100,0			
Tipo de cambio promedio		2,9697			
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$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 294,3**	**4 085,0**	**4 028,7**	**3 984,5**	**3 658,4**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0119%	0,0118%	0,0119%	0,0120%	0,0119%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	490,8	488,4	485,6	482,2	866,7
Tasa de interés	2,30%	2,30%	2,30%	2,30%	2,30%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3 803,5**	**3 596,6**	**3 543,1**	**3 502,3**	**2 791,7**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 932,1	10 982,9	10 770,4	10 683,2	10 567,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,4	11,4	11,2	11,1	10,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	5 351,6	5 122,4	5 029,5	4 942,3	4 826,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,4	5,4	5,2	5,1	5,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	504,5	465,5	998,4	996,0	1 188,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,65/3.80/3,74	3,65/3,75/3,73	3,60/3,60/3,60	3,60/3,65/3,61	3,65/3,85/3,77
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	162,5	75,0	35,0	150,0	202,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,15/0,20/0,17	0.15/0.15/0.15	0.15/0.15/0.15	0.15/0.15/0.15	0.15/0.15/0.15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	57,8	63,0	7,0		
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		29,0 / 3,40			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**12 Diciembre**	**15 Diciembre**	**16 Diciembre**	**17 Diciembre**	**18 Diciembre**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-44,5	-193,1	1,2	30,2	97,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-58,4	14,0	-106,5	12,9	46,4
a. Mercado spot con el público	-128,5	-17,9	-343,0	-104,4	-128,4
i. Compras	371,3	445,3	274,7	411,8	417,1
ii. (-) Ventas	499,8	463,2	617,6	516,2	545,4
b. Compras forward al público (con y sin entreqa)	134,6	-311,9	163,5	79,3	-158,9
i. Pactadas	219,1	95,8	435,1	412,2	267,7
ii. (-) Vencidas	84,5	407,7	271,7	333,0	426,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	219,4	-287,0	154,6	61,9	-210,2
i. Pactadas	273,2	234,5	418,5	346,0	167,1
ii. (-) Vencidas	53,8	521,5	264,0	284,1	377,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	493,5	273,2	510,4	571,2	957,1
ii. A futuro	104,0	135,0	201,5	321,0	40,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	43,7	145,4	128,6	91,1	147,4
i. Compras	47,7	491,2	260,2	270,9	365,6
ii. (-) Ventas	3,9	345,8	131,6	179,9	218,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	94,4	-181,9	199,0	-22,8	-21,9
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,9629	2,9629	2,9697	2,9590	2,9404
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera