

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Solos)

	1 Diciembre 14	2 Diciembre 14	3 Diciembre 14	4 Diciembre 14	5 Diciembre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	2 238,9	2 667,8	2 716,9	2 454,5	2 177,0
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	100,0		100,0	100,0	
Plazo de vencimiento	222,5		356,5	264,5	
Tasas de interés Mínima	192 d		554 d	371 d	
Máxima	3,42		3,46	3,40	
Promedio	3,53		3,46	3,45	
Saldo	15 735,1		15 835,1	15 935,1	15 935,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de Diciembre de 2014		1 000,0		1 000,0	1 000,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 9 y el 12 de Diciembre de 2014		0,0	0,0	0,0	1 000,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	3 200,0	3 100,0	2 700,0	3 300,0	300,0
Plazo de vencimiento	4 625,0	3 715,0	6 090,0	6 977,0	600,0
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	90 d
Máxima	3,57	3,91	4,21	4,28	4,56
Promedio	3,90	4,07	4,26	4,30	4,70
Saldo	3,73	4,02	4,23	4,29	4,62
Próximo vencimiento de Repo el 9 de Diciembre de 2014	3 815,0	3 715,0	3 315,0	3 915,0	5 115,0
Vencimientos de REPO entre el 9 y el 12 de Diciembre de 2014		3 100,0	2 700,0	3 300,0	4 200,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	240,0	50,0	Desierta	60,0	120,0
Plazo de vencimiento	240,0	50,0		60,0	120,0
Tasas de interés Mínima	63 d	63 d		90 d	90 d
Máxima	0,02	0,03		0,10	0,15
Promedio	0,05	0,03		0,10	0,15
Saldo	0,04	0,03		0,10	0,15
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 12 de Diciembre de 2014	2 660,0	2 580,0	2 410,0	2 315,0	2 295,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 9 y el 12 de Diciembre de 2014		170,0	155,0	140,0	300,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas	500,0	465,0	295,0	140,0	300,0
Plazo de vencimiento	1 521,0				1 200,0
Tasas de interés Mínima	364 d				367 d
Máxima	4,21				4,52
Promedio	4,52				4,52
Saldo	4,31				4,52
Próximo vencimiento de Repo el 9 de Diciembre de 2014	5 591,5	5 591,5	5 591,5	5 291,5	5 291,5
Vencimiento de REPO entre el 9 y el 12 de Diciembre de 2014		300,0	300,0	300,0	300,0
vii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	600,1	599,8	300,0	300,0	300,0
Plazo de vencimiento	1 300,0	1 485,0	1 172,0	1 305,0	1 199,0
Tasas de interés Mínima	63 d	63 d	90 d	90 d	182 d
Máxima	0,00	0,00	0,00	-0,01	-0,02
Promedio	0,00	0,00	0,00	0,00	-0,01
Saldo	0,00	0,00	0,00	0,00	-0,02
Próximo vencimiento de SC-Venta (9 de Diciembre de 2014)	13 259,9	14 159,7	14 159,7	14 459,7	14 759,7
Vencimiento de SC-Venta entre el 9 y el 12 de Diciembre de 2014		300,0	300,0	300,0	300,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio	-14,7	-441,6	-147,2	-44,2	-457,7
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio	5,0	150,0	50,0	15,0	155,0
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	2 931,4	2 943,9	2 944,9	2 947,8	2 953,1
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	5 584,3	5 276,2	5 171,7	5 550,3	6 399,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0120%	0,0120%	0,0120%	0,0119%	0,0115%
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					
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	5 564,3	4 819,2	4 700,9	5 064,0	6 024,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11 145,6	10 148,6	11 017,4	10 905,7	10 979,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,0	13,7	11,5	11,4	11,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	4 315,8	4 567,5	5 276,5	5 164,8	5 238,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,5	6,2	5,5	5,4	5,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	609,0	441,0	522,0	543,5	498,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,80/3,69	3,50/3,75/3,67	3,70/4,15/3,88	3,80/4,30/4,20	4,30/5,00/4,70
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	93,0	200,0	142,5	136,5	170,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,10/0,15/0,15	0,10/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,20/0,17	0,12/0,20/0,17
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	45,0	40,0	113,0	40,0	92,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			40,0 / 3,43		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				13,0 / 3,51	
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					92,5 / 3,45
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 Noviembre	01 Diciembre	2 Diciembre	3 Diciembre	4 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	128,4	-79,7	54,1	-164,7	211,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	260,7	-157,7	53,1	-39,4	95,0
a. Mercado spot con el público	-86,7	-294,4	-159,3	-82,2	81,3
i. Compras	345,4	266,2	297,3	241,3	342,8
ii. (-) Ventas	432,0	550,6	455,6	323,6	261,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-131,7	113,0	-5,3	-5,6	-221,7
i. Pactadas	249,5	352,2	353,1	237,9	177,9
ii. (-) Vencidas	381,3	357,6	240,1	243,5	399,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	208,0	121,7	119,7	119,7	-236,7
i. Pactadas	492,4	559,2	711,3	434,5	357,9
ii. (-) Vencidas	286,4	436,5	293,4	314,7	594,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	903,6	607,5	390,0	693,0	632,6
ii. A futuro	195,0	150,0	208,0	177,0	115,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	178,9	249,8	126,6	157,2	214,3
i. Compras	264,1	435,4	291,7	313,9	577,4
ii. (-) Ventas	85,2	185,6	134,5	167,3	363,1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	279,1	160,8	413,4	-12,6	96,1
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,9196	2,9284	2,9410	2,9408	2,9475
(*) Datos preliminares					