BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	9 Diciembre 14	10 Diciembre 14	11 Diciembre 14	12 Diciembre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	**2 029,5**	**1 362,7**	**2 091,6**	**1 432,3**
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	100,0	
Propuestas recibidas		143,0	212,5	
Plazo de vencimiento		547 d	364 d	
Tasas de interés Mínima		3,36	3,30	
Máxima		3,36	3,36	
Promedio		3,36	3,36	
Saldo	15 935,1	16 035,1	15 135,1	15 135,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 08 de Enero de 2015		1 000,0	1 649,8	1 649,8
Vencimientos de CD BCRP entre el 15 y el 19 de Diciembre de 2014		1 000,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	4 400,0	4 400,0	3 600,0	3 459,0
Propuestas recibidas	4 716,5	4 403,5	3 743,5	3 459,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	3,65	3,55	3,59	3,53
Máxima	4,21	4,11	3,95	3,90
Promedio	4,07	3,80	3,68	3,60
Saldo	5 315,0	5 315,0	4 515,0	4 074,0
Próximo vencimiento de Repo el 15 de Diciembre de 2014		5 315,0	3 900,0	3 459,0
Vencimientos de REPO entre el 15 y el 19 de Diciembre de 2014		4 700,0	3 900,0	3 459,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	200,0		300,0	
Propuestas recibidas	200,0		Desierta	
Plazo de vencimiento	90 d			
Tasas de interés Mínima	0,00			
Máxima	0,04			
Promedio	0,02			
Saldo	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 15 y el 19 de Diciembre de 2014		0,0	0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	5 291,5	5 291,5	5 291,5	4 691,5
Próximo vencimiento de Repo el 30 de Diciembre de 2014		300,0	300,0	391,5
Vencimiento de REPO entre el 15 y el 19 de Diciembre de 2014		300,0	300,0	0,0
vii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300,0 300,0	300,0	600,0 600,0	300,0 298,4
Propuestas recibidas	550,0 627,6	800,0	1 294,3 628,9	568,0 298,4
Plazo de vencimiento	182 d 90 d	90 d	90 d 90 d	90 d 90 d
Tasas de interés Mínima	-0,03 -0,03	-0,05	-0,16 -0,21	-0,18 -0,20
Máxima	-0,03 -0,03	-0,05	-0,06 -0,11	0,00 -0,07
Promedio	-0,03 -0,03	-0,05	-0,10 -0,19	-0,20 -0,12
Saldo	15 059,7	15 059,7	15 659,7	15 958,1
Próximo vencimiento de SC-Venta (15 de Diciembre de 2014)		300,0	300,0	230,1
Vencimiento de SC-Venta entre el 15 y el 19 de Diciembre de 2014		900,0	300,0	830,1
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-237,0	-103,74	-178,23	0,00
i. Compras (millones de US$)				
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US$)	80,0	35,0	60,0	
Tipo de cambio promedio	2,9631	2,9639	2,9705	
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público				
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público				
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**5 992,5**	**5 558,9**	**5 413,4**	**4 891,3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0119%	0,0119%	0,0118%	0,0119%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	469,3	462,9	484,6	485,1
Tasa de interés	2,30%	2,30%	2,30%	2,30%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**5 523,2**	**5 096,0**	**4 928,8**	**4 406,2**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11 163,9	11 131,2	11 218,1	11 139,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,7	11,6	11,7	11,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	5 422,9	5 390,2	5 477,2	5 398,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,7	5,6	5,7	5,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	115,5	373,0	248,0	591,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,90/4,00/3,96	3,70/3,75/3,70	3,60/3,75/3,73	3,60/3,75/3,71
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	178,5	220,5	260,5	267,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,15/0,20/0,17	0,15/0,20/0,16	0,15/0,20/0,16	0,15/0,20/0,16
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	160,0	0,0	223,0	186,3
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				98.5 / 3,35
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**5 Diciembre**	**9 Diciembre**	**10 Diciembre**	**11 Diciembre**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	46,8	72,7	-22,0	130,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	64,7	246,5	19,9	-131,9
a. Mercado spot con el público	-236,6	-167,9	-105,9	-274,2
i. Compras	237,9	349,9	395,7	486,0
ii. (-) Ventas	474,5	517,8	501,7	760,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	78,1	-67,2	28,4	140,1
i. Pactadas	350,7	388,3	322,1	450,8
ii. (-) Vencidas	272,7	455,4	293,7	310,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	195,9	205,7	68,3	75,2
i. Pactadas	343,8	425,6	218,7	713,8
ii. (-) Vencidas	148,0	219,9	150,4	638,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	506,7	538,5	499,8	460,6
ii. A futuro	36,0	296,0	175,0	77,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	50,5	39,4	-47,4	448,1
i. Compras	141,7	216,0	147,2	637,6
ii. (-) Ventas	91,2	176,6	194,6	189,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	226,0	238,5	27,9	219,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,9529	2,9641	2,9617	2,9699
(*) Datos preliminares.				

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera