

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	29 Diciembre 14	30 Diciembre 14	31 Diciembre 14
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>2 953,9</b>	<b>2 237,9</b>	<b>2 913,4</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	50,0		25,0
Plazo de vencimiento	145,0		125,0
Tasas de interés: Mínima	164 d		526 d
Máxima	3,49		3,49
Promedio	3,49		3,55
Saldo	3,49		3,52
Próximo vencimiento de CD BCRP el 8 de Enero de 2015	15 550,1	15 550,1	15 575,1
Vencimientos de CD BCRP entre el 5 y el 9 de Enero de 2015		1 649,8	1 649,8
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)		0,0	1 000,0
Propuestas recibidas			1 040,0
Plazo de vencimiento			5 d
Tasas de interés: Mínima			3,98
Máxima			4,05
Promedio			3,98
Saldo	615,0	615,0	1 300,0
Próximo vencimiento de Repo el 5 de Enero de 2015		315,0	1 000,0
Vencimientos de REPO entre el 5 y el 9 de Enero de 2015		0,0	1 000,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	2 590,0	2 590,0	2 590,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 5 de Enero de 2015		210,0	210,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 5 y el 9 de Enero de 2015		0,0	1 060,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera			
Propuestas recibidas			500,0
Plazo de vencimiento			1 175,0
Tasas de interés: Mínima			547 d
Máxima			3,70
Promedio			4,48
Saldo	8 491,5	8 100,0	8 600,0
Próximo vencimiento de Repo el 19 de Febrero de 2015		300,0	300,0
Vencimiento de REPO entre el 5 y el 9 de Enero de 2015		0,0	0,0
vii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300,0	299,9	300,0
Propuestas recibidas	729,8	729,0	929,8
Plazo de vencimiento	60 d	60 d	60 d
Tasas de interés: Mínima	-1,56	-1,96	-2,16
Máxima	-1,77	-1,76	-2,1
Promedio	-1,56	-1,90	-2,03
Saldo	16 397,9	16 472,9	16 772,9
Próximo vencimiento de SC-Venta (5 de Enero de 2014)		300,0	1 450,0
Vencimiento de SC-Venta entre el 5 y el 9 de Enero de 2015		300,0	2 823,4
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR			
i. Compras (millones de US\$)	-358,7	-44,9	-14,9
Tipo de cambio promedio			
ii. Ventas (millones de US\$)	120,0	15,0	5,0
Tipo de cambio promedio	2,9892	2,9940	2,9806
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	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
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>2 545,2</b>	<b>2 193,0</b>	<b>4 373,5</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0118%	0,0118%	0,0118%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional			
Tasa de interés	1 159,3	1 021,5	517,0
	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>1 385,9</b>	<b>1 171,5</b>	<b>3 856,5</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	9 546,8	9 726,0	9 716,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,9	10,1	10,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	4 240,7	4 138,4	4 129,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,1	4,3	4,3
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 167,0	1 447,5	538,7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,45/3,50/3,50	3,45/3,50/3,50	3,50/4,00/3,55
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	9,5	10,0	4,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	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	0,0	0,0	3,2
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			
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>26 Diciembre</b>	<b>29 Diciembre</b>	<b>30 Diciembre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-177,1	166,1	-83,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-49,5	-25,2	10,2
a. Mercado spot con el público	-101,5	-327,3	-276,5
i. Compras	175,3	277,4	305,3
ii. (-) Ventas	277,9	604,7	581,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	435,4	78,3	-373,3
i. Pactadas	621,9	513,9	294,6
ii. (-) Vencidas	186,6	435,6	667,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	562,9	-20,2	-260,9
i. Pactadas	709,2	261,3	409,5
ii. (-) Vencidas	146,3	281,5	670,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	227,2	315,3	590,6
ii. A futuro	110,0	235,0	218,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	23,0	98,4	274,2
i. Compras	143,1	273,1	663,6
ii. (-) Ventas	120,2	174,8	389,4
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-11,2	142,4	33,3
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,9754	2,9885	2,9889
(*) Datos preliminares			