

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

	19 Enero 15	20 Enero 15	21 Enero 15	22 Enero 15	23 Enero 15
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	4 612,9	4 230,4	3 557,2	3 390,2	3 378,9
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	200,0	100,0	100,0	200,0
Plazo de vencimiento	326,8	559,1	282,0	341,6	444,3
Tasas de interés: Mínima	17,8 d	86 d	540 d	350 d	90 d
Máxima	3,22	3,28	3,35	3,30	3,25
Promedio	3,36	3,35	3,35	3,32	3,35
Saldo	3,32	3,32	3,35	3,32	3,30
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Febrero de 2015	16 855,3	17 055,3	17 155,3	17 255,3	17 455,3
Vencimientos de CD BCRP entre el 26 y 30 de Enero de 2015			1 070,0	1 070,0	1 070,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			0,0	0,0	0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Próximo vencimiento de Repo el 5 de Marzo de 2015			0,0	0,0	0,0
Vencimientos de REPO entre el 26 y 30 de Enero de 2015			800,0	899,9	1 500,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 200,0	1 400,0	800,0	899,9	1 500,0
Plazo de vencimiento	2 586,0	2 380,0	1 793,2	1 306,0	2 411,3
Tasas de interés: Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	2,60	2,50	2,35	2,10	2,05
Promedio	2,75	2,70	2,59	2,52	2,52
Saldo	2,70	2,61	2,53	2,48	2,43
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 26 de Enero de 2015	1 200,0	1 400,0	800,0	899,9	1 500,0
Vencimientos de Depósitos a Plazo entre el 26 y 30 de Enero de 2015			800,0	899,9	1 500,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 230,0	2 230,0	2 230,0	2 230,0	2 230,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 26 de Enero de 2015			60,0	60,0	60,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 26 y 30 de Enero de 2015			0,0	0,0	360,0
v. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	8 900,0	8 900,0	8 900,0	8 900,0	8 900,0
Próximo vencimiento de Repo el 19 de Febrero de 2015			300,0	300,0	300,0
Vencimientos de REPO entre el 26 y 30 de Enero de 2015			0,0	0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	300,0	300,0	300,0	300,0	600,0
Próximo vencimiento de Repo el 17 de Enero de 2017			300,0	300,0	300,0
Vencimientos de REPO entre el 26 y 30 de Enero de 2015			0,0	0,0	0,0
vii. Subasta de Swap Cambiano Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	16 863,3	16 863,3	16 598,3	16 598,3	17 498,3
Próximo vencimiento de SC-Venta el 26 de Enero de 2015			300,0	300,0	300,0
Vencimientos de SC-Venta entre el 26 y 30 de Enero de 2015			0,0	0,0	899,9
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0	-135,9
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					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 312,9	2 630,4	2 657,2	2 390,3	1 843,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0117%	0,0117%	0,0117%	0,0117%	0,0117%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	742,8	579,0	394,0	502,2	749,0
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	2 570,1	2 051,4	2 263,2	1 888,1	1 094,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 331,3	10 414,9	10 123,4	10 011,7	9 901,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,6	10,7	10,4	10,3	10,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	4 441,8	4 119,2	4 030,8	3 919,1	3 808,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,4	4,5	4,2	4,0	3,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	560,0	459,0	543,0	1 108,0	1 317,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,10/3,25/3,23	3,20/3,25/3,24	3,25/3,25/3,25	3,15/3,25/3,24	3,15/3,25/3,20
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	176,0	207,8	267,3	309,3	247,3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,20/0,25/0,20	0,20/0,30/0,24	0,20/0,25/0,21	0,20/0,30/0,21	0,20/0,25/0,22
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	16 Enero 15	19 Enero 15	20 Enero 15	21 Enero 15	22 Enero 15
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	77,8	-52,8	-266,1	12,3	-121,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-89,3	-43,6	-64,1	267,3	-25,6
a. Mercado spot con el público	-157,6	-78,7	-94,6	50,4	-137,6
i. Compras	268,0	145,3	204,2	320,9	348,7
ii. (-) Ventas	425,7	224,0	298,8	270,5	486,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-62,6	21,2	-140,9	-66,0	-160,4
i. Pactadas	128,9	59,1	96,3	212,1	215,3
ii. (-) Vencidas	191,5	37,9	237,3	278,1	375,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	2,9	30,4	61,0	98,1	-64,3
i. Pactadas	244,4	34,8	342,1	264,1	274,9
ii. (-) Vencidas	241,5	4,4	281,1	165,9	339,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	377,2	271,2	662,2	909,0	830,7
ii. A futuro	25,0	20,0	55,0	175,0	205,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	113,5	1,6	82,5	105,0	75,8
i. Compras	241,1	1,9	270,6	165,8	322,4
ii. (-) Ventas	127,6	0,3	188,1	60,8	246,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	237,4	0,0	-8,2	-91,2	-0,3
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,0133	3,0097	3,0101	3,0097	3,0022
(*) Datos preliminares					