

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	22 Diciembre 14	23 Diciembre 14	24 Diciembre 14	26 Diciembre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	2 537,1	2 479,7	3 144,9	2 436,3
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)				
Propuestas recibidas	100,0		20,0	
Plazo de vencimiento	172,0		160,0	
Tasas de interés: Mínima	171 d		533 d	
Máxima	3,36		3,50	
Promedio	3,70		3,55	
Saldo	3,63		3,51	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 08 de Enero de 2015	15 480,1	15 480,1	15 500,1	15 500,1
Vencimientos de CD BCRP del 29 al 31 de Diciembre de 2014		1 649,8		1 649,8
0,0		0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas	1 200,0	800,0	1 045,0	1 000,0
Plazo de vencimiento	2 507,0	1 817,0	1 045,0	1 000,0
Tasas de interés: Mínima	1 d	1 d	2 d	3 d
Máxima	3,77	3,97	3,56	3,50
Promedio	3,87	3,97	4,01	3,98
Saldo	3,81	3,97	3,98	3,57
Próximo vencimiento de Repo el 29 de Diciembre de 2014	2 915,0	2 415,0	2 600,0	1 615,0
Vencimientos de REPO del 29 al 31 de Diciembre de 2014		800,0		1 000,0
0,0		1 800,0		1 315,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas			300,0	
Plazo de vencimiento			330,0	
Tasas de interés: Mínima			62 d	
Máxima			0,05	
Promedio			0,05	
Saldo			0,05	
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 29 de Diciembre de 2014	2 495,0	2 495,0	2 795,0	2 795,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables del 29 al 31 de Diciembre de 2014		205,0		205,0
0,0		0,0		0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera				
Propuestas recibidas		500,0	400,0	300,0
Plazo de vencimiento		1 420,0	1 130,0	934,0
Tasas de interés: Mínima		365 d	364 d	367 d
Máxima		4,38	4,38	4,35
Promedio		4,51	4,38	4,45
Saldo		4,44	4,38	4,41
Próximo vencimiento de Repo el 30 de Diciembre de 2014	7 291,5	7 791,5	8 191,5	8 491,5
Vencimiento de REPO del 29 al 31 de Diciembre de 2014		391,5		391,5
0,0		0,0		391,5
vii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				
Propuestas recibidas	300,0	300,0	300,0	
Plazo de vencimiento	748,7	500,0	1 000,0	
Tasas de interés: Mínima	63 d	63 d	62 d	
Máxima	-0,55	-0,77	-1,06	
Promedio	-0,55	-0,77	-1,06	
Saldo	-0,55	-0,77	-1,06	
Próximo vencimiento de SC-Venta (29 de Diciembre de 2014)	16 628,1	16 398,1	16 098,0	16 098,0
Vencimiento de SC-Venta del 29 al 31 de Diciembre de 2014		600,1		900,0
0,0		600,1		900,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,00	-6,0	0,0
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US\$)			2,0	
Tipo de cambio promedio			2,9820	
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)				
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público				
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
ii. Compras de BTP				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 637,1	3 779,7	4 263,9	3 736,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Comisión (tasa efectiva diaria)				
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0118%	0,0118%	0,0110%	0,0118%
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
Tasa de interés	459,7	964,0	841,0	2 149,3
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,30%	2,30%	2,30%	2,30%
Tasa de interés				
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 177,4	2 795,7	3 422,9	1 587,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 336,3	10 406,9	10 044,0	9 868,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,7	10,8	10,4	10,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	4 751,0	4 666,0	4 427,2	4 273,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,8	4,8	4,6	4,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	898,0	1 114,6	957,0	565,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,65/3,80/3,75	3,80/3,90/3,85	3,60/3,95/3,85	3,40/3,60/3,53
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	142,0	152,0	115,0	69,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,150/2,00/1,7	0,150/2,00/1,7	0,150/2,00/1,7	0,150/1,50/1,5
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	45,3	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		3,80 / 3,35		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	19 Diciembre	22 Diciembre	23 Diciembre	24 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-172,3	313,6	-107,1	74,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-20,1	209,6	-207,9	27,3
a. Mercado spot con el público	-175,9	-58,7	-347,5	-139,0
i. Compras	299,0	512,2	349,0	164,8
ii. (-) Ventas	474,9	570,8	696,5	303,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-100,2	-77,1	135,9	83,5
i. Pactadas	208,6	347,2	533,7	214,4
ii. (-) Vencidas	308,8	424,4	397,7	130,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	153,7	20,7	-43,9	-68,8
i. Pactadas	284,3	169,5	263,1	340,6
ii. (-) Vencidas	130,6	148,8	307,1	409,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
ii. Al contado	590,0	477,0	719,6	809,0
ii. A futuro	308,0	258,0	410,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-21,9	-1,5	88,1	342,5
i. Compras	125,3	145,5	284,7	406,9
ii. (-) Ventas	147,2	147,0	196,6	64,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	101,2	196,1	-118,2	-3,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,9526	2,9722	2,9754	2,9786
(*) Datos preliminares				