BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	31 Marzo 14	1 Abril 14	2 Abril 14	3 Abril 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	**6,292.9**	**6,163.6**	**6,818.3**	**7,096.0**
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 BCR (CD BCRP)	30.0		30.0	30.0
Propuestas recibidas	211.3		119.0	270.0
Plazo de vencimiento	199 d		561 d	371 d
Tasas de interés Mínima	3.45		3.57	3.53
Máxima	3.53		3.62	3.54
Promedio	3.51		3.62	3.53
Saldo	14,612.5	14,612.5	14,642.5	14,672.5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Abril de 2014		2,040.4		2,040.4
Vencimientos de CD BCRP el 4 de Abril de 2014		0.0		0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)		1 000,0 1 000,0	500,0 1 000,0	1,000.0
Propuestas recibidas		1 880,0 3 215,5	530,0 1 341,0	1,732.5
Plazo de vencimiento		7 d 1 d	7 d 1 d	1 d
Tasas de interés Mínima		4,15 4,17	4,16 4,18	4.08
Máxima		4,51 4,25	4,25 4,23	4.23
Promedio		4,24 4,21	4,21 4,21	4.16
Saldo	500.0	2,500.0	2,500.0	2,500.0
Próximo vencimiento de Repo el 4 de Abril de 2014		1,500.0		1,000.0
Vencimientos de REPO el 4 de Abril de 2014		1,500.0		1,000.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)				200.0
Propuestas recibidas				200.0
Plazo de vencimiento				61 d
Tasas de interés Mínima				0.03
Máxima				0.03
Promedio				0.03
Saldo	3,871.1	3,771.1	3,581.1	3,781.1
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 4 de Abril de 2014		190.0		300.0
Vencimientos de Depósitos Reajustables el 4 de Abril de 2014		490.0		300.0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	300.0	300.0	300.0	300.0
Próximo vencimiento de Repo (21 de Setiembre de 2015)		300.0		300.0
Vencimientos de REPO el 4 de Abril de 2014		0.0		0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	0.0	0.0
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$)	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público				
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público				
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**6,262.9**	**8,163.6**	**8,288.3**	**7,866.0**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0125%	0.0125%	0.0125%	0.0125%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	3,066.5	6.8	1.6	6.8
Tasa de interés	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3,196.4**	**8,156.8**	**8,286.7**	**7,859.2**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11,558.9	13,229.2	12,428.9	13,203.1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12.7	24.0	16.5	14.5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6,632.8	8,156.8	8,156.7	8,057.6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.1	14.8	9.7	8.8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	733.0	253.5	277.0	812.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,83/4,00/3,99	4,00/4,25/4,01	4,00/4,00/4,00	4,00/4,05/4,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	31.0	86.0	83.5	123.8
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,15/0,15/0,15	0,10/0,15/0,12	0,10/0,15/0,12	0,10/0,15/0,12
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	0.0	0.0	27.2
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$)	**28 Marzo 2014**	**31 Marzo 2014**	**31 Marzo 2014**	**01 Abril 2014**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	**29.3**	**1.9**	**1.0**	**40.2**
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	**84.0**	**15.1**	**14.3**	**-100.2**
a. Mercado spot con el público	**-37.2**	**-142.7**	**-143.6**	**-125.0**
i. Compras	470.7	384.0	384.0	336.1
ii. (-) Ventas	507.8	526.8	527.6	461.1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	**68.8**	**-5.6**	**-5.6**	**-3.3**
i. Pactadas	259.6	281.5	281.5	130.7
ii. (-) Vencidas	190.8	287.2	287.2	134.0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	**123.5**	**7.6**	**7.6**	**-143.7**
i. Pactadas	161.3	303.8	303.8	52.0
ii. (-) Vencidas	37.8	296.2	296.2	195.7
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	1094.3	759.9	759.9	579.6
ii. A futuro	43.0	15.0	15.0	30.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	**0.7**	**220.9**	**220.9**	**121.6**
i. Compras	34.8	293.8	293.8	194.6
ii. (-) Ventas	34.1	72.9	72.9	73.0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	**-32.5**	**-54.0**	**-54.0**	**-35.1**
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.8100	2.8086	2.8086	2.8061
(*) Datos preliminares				

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera