

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

	Millones de Nuevos Soles				
	25 Enero 16	26 Enero 16	27 Enero 16	28 Enero 16	29 Enero 16
	3 801,5	3 466,8	3 930,6	4 481,6	4 537,6
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</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	30,1		30,0	30,0	100,1
Plazo de vencimiento	94,0		100,0	30,0	100,1
Tasas de interés: Mínima	4,50		5,16	3,90	1,75
Máxima	4,50		5,16	4,90	4,50
Promedio	4,49		5,15	4,90	4,50
Saldo	15 472,1	15 472,1	15 502,1	15 632,2	15 701,2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de Febrero de 2016	1 050,0		1 050,0		1 050,0
Vencimiento de CD BCRP entre el 1 y el 5 de Febrero de 2016	0,0		0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
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 de Valores el 17 de Junio de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 1 y el 5 de Febrero de 2016	0,0		0,0		0,0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial) - CDR					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 900,0	1 900,0	1 900,0	1 600,0	1 600,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 26 de Febrero de 2016	300,3		300,3		300,3
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 1 y el 5 de Febrero de 2016	1 165,0	1 100,0	1 500,1	1 295,0	2 000,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	1 165,0	1 272,8	1 167,0	1 295,0	2 248,3
Propuestas recibidas	1,4	1,4	1,4	1,4	1,4
Plazo de vencimiento	3,95	3,90	3,97	3,95	3,95
Tasas de interés: Mínima	4,00	4,00	4,00	4,00	4,00
Máxima	3,99	3,93	4,00	3,97	3,97
Promedio	3,99	3,93	4,00	3,97	3,97
Saldo	2 265,0	2 440,2	2 489,2	3 295,0	3 076,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 29 de Enero de 2016	2 265,0		2 489,2		3 076,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 1 y el 5 de Febrero de 2016	2 265,0		2 489,2		3 076,0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 050,0	3 050,0	3 050,0	3 050,0	3 050,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 19 de Febrero de 2016	3 050,0		3 050,0		3 050,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 1 y el 5 de Febrero de 2016	0,0		0,0		0,0
vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Coloc - BN entre el 1 y el 5 de Febrero de 2016	300,0		300,0		300,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Resustituibles del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	302,0	69	117	117	184
Plazo de vencimiento	52,4	69	62,4	62,4	62,4
Tasas de interés: Mínima	0,65	0,65	0,75	0,75	0,75
Máxima	0,75	0,75	0,75	0,75	0,75
Promedio	0,72	0,67	0,75	0,75	0,75
Saldo	9 108,5	8 866,5	8 750,5	8 150,5	7 660,5
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 4 de Febrero de 2016	300,0		600,3		78,6
Vencimiento de CDR BCRP entre el 1 y el 5 de Febrero de 2016	2 000,0		1 400,3		248,6
ix. Compra con compromiso de Reconquista de moneda extranjera (Reoular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	14 900,0	14 900,0	14 900,0	14 900,0	14 400,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 5 de Febrero de 2016	500,0		500,0		400,0
Vencimiento de REPO Regular el 1 y el 5 de Febrero de 2016	500,0		500,0		400,0
x. Compra con compromiso de Reconquista de moneda extranjera (Exansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0	7 900,0
Próximo vencimiento de Repo Exansión el 17 de Enero de 2017	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO Exansión el 1 y el 5 de Febrero de 2016	0,0		0,0		0,0
xi. Compra con compromiso de Reconquista de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7	4 804,7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017	243,0		243,0		243,0
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 1 y el 5 de Febrero de 2016	0,0		0,0		0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Vertel del BCRP	800	150	200	353	300,1
Propuestas recibidas	127,4	619	450	895	498,0
Plazo de vencimiento	91,4	92,4	92,4	92,4	92,4
Tasas de interés: Mínima	0,75	0,75	0,75	0,75	0,75
Máxima	0,75	0,75	0,75	0,75	0,75
Promedio	0,75	0,75	0,75	0,75	0,75
Saldo	28 497,0	28 866,0	28 866,0	28 866,0	28 406,0
Próximo vencimiento de SC-Vertel el 2 de Febrero de 2016	850,0		725,0		300,0
Vencimiento de SC - Vertel entre el 1 y el 5 de Febrero de 2016	2 794,4		1 868,0		1 106,3
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	-294,2	-97,1	0,0	-62,4	-208,3
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio	85,0	28,0	18,0	60,0	60,0
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	3 460,9	3 466,4	3 466,6	3 466,6	3 471,6
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					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>912,3</b>	<b>788,4</b>	<b>1 227,4</b>	<b>994,0</b>	<b>884,3</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (base efectiva diaria)	0,0131%	0,0130%	0,0130%	0,0130%	0,0121%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,30%	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%	4,30%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	241,9	155,6	306,5	289,3	298,4
Promedio	2,75%	2,75%	2,75%	2,75%	2,75%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>670,4</b>	<b>632,8</b>	<b>620,9</b>	<b>724,7</b>	<b>589,9</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 181,9	7 170,0	7 249,9	7 136,6	7 122,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,0	7,0	7,0	7,0	6,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 151,9	2 137,3	2 092,2	2 096,5	1 986,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,1	2,1	2,1	2,0	2,0
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	871,0	901,5	1 464,0	888,0	923,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,004/0,0/4,0	4,004/0,0/4,0	4,004/0,0/4,0	4,004/0,0/4,0	4,004/0,0/4,0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	89,0	107,0	119,0	53,0	97,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,350/3,0/3,35	0,350/3,0/3,35	0,350/3,0/3,35	0,350/3,0/3,35	0,350/3,0/3,35
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
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>22 Enero 16</b>	<b>25 Enero 16</b>	<b>26 Enero 16</b>	<b>27 Enero 16</b>	<b>28 Enero 16</b>
Flujo de la posición global - a + b + c + e + f + g	-35,8	113,9	56,5	-80,1	-103,7
Flujo de la posición contable - a + b + c + d + e + f + g	-88,4	101,8	-152,7	-85,4	-238,0
a. Mercado spot con el público	-143,0	-82,7	-206,9	-113,8	-109,4
i. Compras	107,9	233,1	211,2	189,0	227,8
ii. (i) Ventas	300,9	315,8	418,2	301,9	333,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	54,0	-61,4	-61,7	-61,6	158,0
i. Pactadas	126,0	84,1	87,6	87,6	243,0
ii. (i) Vencidas	72,0	130,5	53,4	151,1	75,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	89,4	89,7	-109,4	-72,4	128,2
i. Pactadas	104,1	203,3	175,2	153,7	225,0
ii. (i) Vencidas	68,7	133,6	206,0	72,2	72,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	624,6	363,2	471,0	228,3	188,7
ii. A futuro	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	66,7	81,6	283,3	44,7	44,7
i. Compras	68,4	132,1	283,3	19,3	41,3
ii. (i) Ventas	1,7	50,4	0,0	58,3	16,7
f. Efecto de Docenas	63,3	103,3	-9,7	10,0	5,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	18,9	24,7	61,9	-48,2	-58,8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Igual por regulación monetaria en moneda extranjera					
Ni) Efecto de Docenas					
N) Efecto de Docenas	3 446,5	3 459,2	3 467,9	3 464,9	3 465,5