

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Sol)

	22 Febrero 16	23 Febrero 16	24 Febrero 16	25 Febrero 16	26 Febrero 16
	2 317,5	2 456,3	2 216,4	2 119,7	1 987,9
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>2 317,5</b>	<b>2 456,3</b>	<b>2 216,4</b>	<b>2 119,7</b>	<b>1 987,9</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones</b>					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCRP					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	100	30	195,0	155,9	83,8
Propuestas recibidas	200	85	195,0	236,9	123,3
Plazo de vencimiento	303,4	111,4	7,4	7,4	503,4
Tasas de interés: Mínima	5,10	4,90	4,23	4,28	4,40
Máxima	5,10	4,90	4,56	4,56	5,30
Promedio	5,10	4,90	4,28	4,54	5,49
Saldo	17 274,3	17 626,2	17 738,0	17 744,0	17 744,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Marzo de 2016	1 635,0	1 635,0	1 635,0	1 635,0	1 635,0
Vencimiento de CD BCRP entre el 29 de Febrero y el 4 de Marzo de 2016	0,0	0,0	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	300,0	300,0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 29 de Febrero y el 4 de Marzo de 2016	0,0	0,0	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	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 29 de Febrero de 2016	500,8	500,8	500,8	500,8	500,8
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 29 de Febrero y el 4 de Marzo de 2016	1 149,8	1 149,8	1 149,8	1 149,8	1 149,8
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 498,0	1 498,0	1 498,0	1 498,0	1 498,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 29 de Febrero de 2016	1 498,0	1 498,0	1 498,0	1 498,0	1 498,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 29 de Febrero y el 4 de Marzo de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 500,0	2 500,0	2 500,0	2 500,0	2 500,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 13 de Mayo de 2016	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 29 de Febrero y el 4 de Marzo de 2016	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
vi. 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 de Mayo de 2016	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc - BN entre el 29 de Febrero y el 4 de Marzo de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Subasta de Certificados de Depósitos Resustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	8 122,8	8 002,8	8 002,8	8 002,8	8 002,8
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 29 de Febrero de 2016	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 29 de Febrero y el 4 de Marzo de 2016	788,0	788,0	788,0	788,0	788,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reoular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	14 000,0	14 000,0	14 000,0	14 000,0	14 000,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 14 de Abril de 2016	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO entre el 29 de Febrero y el 4 de Marzo de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Compra con compromiso de Recompra 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 Expansión el 17 de Enero de 2017	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO Expansión entre el 29 de Febrero y el 4 de Marzo de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Compra con compromiso de Recompra 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	243,0	243,0
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 29 de Febrero y el 4 de Marzo de 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	495	35	140	272	0,0
Plazo de vencimiento	875	70	140	822	740
Tasas de interés: Mínima	91,4	91,4	182,4	91,4	91,4
Máxima	0,75	0,75	0,74	0,75	0,75
Promedio	0,75	0,75	0,74	0,75	0,75
Saldo	31 221,7	31 448,7	31 448,7	31 311,7	31 201,7
Próximo vencimiento de SC-Venta el 29 de Febrero de 2016	700,0	700,0	700,0	700,0	700,0
Vencimiento de SC - Venta entre el 29 de Febrero y el 4 de Marzo de 2016	1 940,0	1 240,0	1 240,0	1 940,0	2 786,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-183,0	-229,4	-275,6	-137,6	-59,9
i. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	3 519,7	3 529,7	3 529,7	3 529,7	3 529,7
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
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>854,6</b>	<b>678,9</b>	<b>1 256,4</b>	<b>1 002,8</b>	<b>655,5</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0,0128%	0,0128%	0,0128%	0,0128%	0,0128%
Comisión (base efectiva diaria)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	5,30%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	18,0	154,3	104,7	62,3	16,3
Tasa de interés	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	938,6	714,6	1 150,7	942,5	639,5
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>938,6</b>	<b>714,6</b>	<b>1 150,7</b>	<b>942,5</b>	<b>639,5</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 107,3	6 972,7	6 972,7	6 964,4	6 964,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,0	6,9	6,9	6,8	6,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	1 979,9	1 915,9	1 884,0	1 833,9	1 788,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,8	1,8	1,9	1,8	1,8
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 770,0	1 628,0	1 256,9	812,0	1 232,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,90/7,5/0,7	4,95/26,2/2	4,95/26,5/31	4,80/25,6/11	5,10/25,2/16
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	24,0	8,0	15,0	7,0	15,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,380/380/38	0,380/380/38	0,380/380/38	0,380/380/38	0,380/380/38
c. Total mercado secundario de CDBCRP - CDBCRP-NR y CDV	105,0	70,0	97,4	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	105,0 / 5,10	20 / 4,90			
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>19 Febrero 16</b>	<b>22 Febrero 16</b>	<b>23 Febrero 16</b>	<b>24 Febrero 16</b>	<b>25 Febrero 16</b>
Flujo de la posición global - a + b + c + e + f + g	76,6	42,3	45,4	-85,5	-123,7
Flujo de la posición contable - a + b + c + d + e + f + g	72,0	-26,4	-10,1	67,1	18,6
a. Mercado spot con el público	4,9	27,0	-58,0	-61,3	-61,3
i. Compras	199,3	214,7	146,6	153,2	217,6
ii. Ventas	194,4	187,7	204,6	216,5	278,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-31,2	-16,6	9,7	-15,4	-157,8
i. Paquetadas	9,8	91,3	91,2	91,8	19,5
ii. (i) Vencidas	40,9	87,9	81,5	108,2	157,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	30,3	-75,6	16,4	166,8	-126,4
i. Paquetadas	133,7	159,1	166,4	219,7	306,1
ii. (i) Vencidas	103,4	234,7	150,0	52,8	431,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
Al contado	779,0	1037,1	454,3	1087,0	791,8
ii. Al futuro	0,0	5,5	0,0	0,0	31,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	73,3	85,0	26,4	268,9	268,9
i. Compras	74,2	224,9	148,2	48,5	380,8
ii. (i) Ventas	0,8	63,2	63,2	111,9	9,9
f. Efecto de Docenas	11,2	8,9	8,9	16,1	3,6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	111,1	-77,8	86,7	22,0	-41,1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Igual por regulación monetaria en moneda extranjera					
Neto: Igual por regulación monetaria promedio (Fuente: Databank)	3,5136	3,5201	3,5300	3,5267	3,5267
N) Bases contables					