

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Sol)

	4 Enero 16	5 Enero 16	6 Enero 16	7 Enero 16	8 Enero 16
	3 337,7	4 615,7	5 325,3	6 675,6	6 627,1
<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)	30,0		30,0	200,0	200,0
Propuestas recibidas	91,0		125,0	750,3	727,0
Plazo de vencimiento	192,4		254,4	391,4	391,4
Tasas de interés: Mínima	4,28		5,10	4,65	4,14
Máxima	4,38		5,10	4,74	4,20
Promedio	4,38		5,10	4,70	4,17
Saldo	15 210,1	15 210,1	15 440,1	14 370,1	14 770,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Enero de 2016	1 300,0		1 300,0		400,0
Vencimiento de CD BCRP entre el 11 y el 15 de Enero de 2016	1 300,0		1 300,0		1 750,0
i. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	250,0	250,0	250,0		
Propuestas recibidas	926,0	906,0	956,0		
Plazo de vencimiento	1,6	1,6	1,6		
Tasas de interés: Mínima	4,10	4,10	4,00		
Máxima	4,10	4,10	4,00		
Promedio	4,10	4,01	4,00		
Saldo	950,0	950,0	950,0		
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 17 de Junio de 2016	250,0		250,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 11 y el 15 de Enero de 2016	950,0		950,0		300,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					91,6
Máxima					0,65
Promedio					0,65
Saldo	1 900,0	1 900,0	1 900,0	1 900,0	1 900,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 28 de Enero de 2016	300,3		300,3		300,3
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 11 y el 15 de Enero de 2016	0,0		0,0		0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				500,0	1 750,0
Propuestas recibidas				1 429,8	3 150,1
Plazo de vencimiento				1,6	1,6
Tasas de interés: Mínima				3,44	3,50
Máxima				3,70	3,67
Promedio				3,63	3,67
Saldo	0,0	0,0	300,1	2 250,0	2 000,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 11 de Enero de 2016.					2 000,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 11 y el 15 de Enero de 2016					2 000,0
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público	600,0		300,1		
Propuestas recibidas	1 333,2				
Plazo de vencimiento	183,4				
Tasas de interés: Mínima	6,85				
Máxima	6,85				
Promedio	6,84				
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	650,0		650,0		550,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 11 y el 15 de Enero de 2016	650,0		650,0		550,0
vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación	0,0		0,0		0,0
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 11 y el 15 de Enero de 2016	0,0		0,0		0,0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Resurtables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					388,0
Máxima					3,73
Promedio					0,65
Saldo	6 758,5	6 758,5	6 758,5	6 758,5	7 058,5
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 13 de Enero de 2016	195,0		195,0		195,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 11 y el 15 de Enero de 2016	195,0		195,0		263,0
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	14 900,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 14 de Enero de 2016	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO Regular el 11 y el 15 de Enero de 2016	0,0		0,0		300,0
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 entre el 11 y el 15 de Enero 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 11 y el 15 de Enero de 2016	0,0		0,0		0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	600,0	300,0	300,0	500,0	300,0
Propuestas recibidas	798,0	467,3	300,0	322,0	389,6
Plazo de vencimiento	62,4	91,6	152,6	91,4	152,4
Tasas de interés: Mínima	0,74	0,73	0,69	0,74	0,68
Máxima	0,745	0,73	0,69	0,75	0,75
Promedio	0,745	0,74	0,70	0,75	0,69
Saldo	27 655,7	27 355,7	27 655,7	27 956,7	27 956,7
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 de Enero de 2016	300,0		499,0		200,0
Vencimiento de SC - Venta entre el 11 y el 15 de Enero de 2016	1 099,0		1 099,0		2 288,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	274,2	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)	80,0				
Tipo de cambio promedio	3,4275				
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>3 783,5</b>	<b>4 869,7</b>	<b>5 045,2</b>	<b>4 190,5</b>	<b>3 927,1</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (base efectiva diaria)	0,0103%	0,0103%	0,0103%	0,0103%	0,0122%
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	271,4	271,7	129,0	577,6	577,6
Tasa de interés	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%	2,25%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>3 442,1</b>	<b>4 589,9</b>	<b>4 916,2</b>	<b>4 609,7</b>	<b>3 448,9</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 676,6	7 263,7	7 698,3	7 752,4	7 625,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,7	7,9	8,3	7,6	7,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	1 904,6	2 308,7	2 743,3	2 667,1	2 752,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,1	2,5	2,9	2,6	2,7
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	90,0	214,0	372,0	680,0	654,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,104/104,10	4,004/104,06	3,753/300,76	3,753/76,76	3,753/76,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	17,0	37,0	186,0	153,0	188,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,350/300,35	0,400/400,40	0,360/300,35	0,300/300,35	0,300/300,35
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)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>31 Diciembre 15</b>	<b>04 Enero 16</b>	<b>05 Enero 16</b>	<b>06 Enero 16</b>	<b>07 Enero 16</b>
Flujo de la posición global = a + b + c + e + f + g	45,2	108,6	-107,9	-25,9	77,6
Flujo de la posición contable = a + b + c + d + e + f + g	46,6	104,2	-149,8	-64,6	36,5
a. Mercado spot con el público	-53,6	-155,4	-162,4	-56,4	7,2
i. Compras	96,5	172,4	152,0	207,2	207,2
ii. (i) Ventas	149,1	327,8	314,3	263,6	290,0
ii. (i) Ventas forward al público (con y sin entrada)	54,2	-7,1	-16,5	34,9	8,6
ii. (i) Ventas forward al público (con y sin entrada)	1,1	96,4	41,4	119,4	103,2
ii. (i) Ventas forward al público (con y sin entrada)	61,5	153,5	96,0	24,5	54,5
ii. (i) Ventas forward al público (con y sin entrada)	-5,1	3,5	-50,4	147,3	23,6
ii. (i) Ventas forward al público (con y sin entrada)	60,5	222,0	263,4	263,4	377,8
ii. (i) Ventas forward al público (con y sin entrada)	65,6	218,5	312,2	116,2	349,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
ii. Al contado	398,3	253,9	811,5	585,0	455,0
ii. Al futuro	3,0	10,0	5,0	6,0	8,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrada	31,5	130,1	279,5	108,8	291,0
f. Compras	54,3	197,4	312,0	113,2	331,9
ii. (i) Ventas	33,4	67,3	32,5	4,6	40,8
ii. (i) Ventas	1,0	16,3	17,2	1,4	19,8
ii. (i) Ventas	72,6	243,3	12,5	67,4	73,8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Igual por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Igual por regulación monetaria en moneda extranjera (Fuente: Databank)					
<b>N) Bases contables</b>	<b>3 412,5</b>	<b>3 429,2</b>	<b>3 415,2</b>	<b>3 417,3</b>	<b>3 421,9</b>