

| BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU | | | | | |
|--|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS | | | | | |
| Millones de Nuevos Soles | | | | | |
| | 23 Febrero 15 | 24 Febrero 15 | 25 Febrero 15 | 26 Febrero 15 | 27 Febrero 15 |
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 1 600,7 | 2 249,6 | 2 538,9 | 1 935,8 | 1 414,4 |
| 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 | | 100,0 | 100,0 | 18 185,3 |
| Plazo de vencimiento | 245,4 | | 118,1 | 205,0 | 820,0 |
| Tasas de interés: Mínima | 171,4 | | 533,4 | 350,4 | 354,0 |
| Máxima | 3,16 | | 3,29 | 3,13 | 3,26 |
| Promedio | 3,21 | | 3,31 | 3,35 | 3,38 |
| Saldo | 3,19 | | 3,30 | 3,28 | 3,31 |
| Vencimientos de CD BCRP entre el 12 de Marzo de 2015 | 17 985,3 | 17 985,3 | 18 085,3 | 18 185,3 | 18 185,3 |
| Vencimientos de CD BCRP entre el 2 y 6 de Marzo de 2015 | 820,0 | | 820,0 | 820,0 | 820,0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | | | | | |
| Propuestas recibidas | 500,0 | 440,0 | 300,0 | 300,0 | 354,0 |
| Plazo de vencimiento | 1 010,0 | 440,0 | 0,0 | 0,0 | 354,0 |
| Tasas de interés: Mínima | 7 d | 1 d | | | 3 d |
| Máxima | 3,66 | 3,25 | | | 3,26 |
| Promedio | 3,79 | 3,38 | | | 3,38 |
| Saldo | 3,66 | 3,51 | | | 3,31 |
| Vencimientos de REPO entre el 2 y 6 de Marzo de 2015 | 1 540,0 | 1 100,0 | 1 100,0 | 1 100,0 | 1 454,0 |
| Vencimientos de REPO entre el 2 y 6 de Marzo de 2015 | 500,0 | | 500,0 | 500,0 | 854,0 |
| iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | 200,0 | | 0,0 | 0,0 | 1 154,0 |
| Plazo de vencimiento | 200,0 | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | 58 d | | | | |
| Máxima | 0,13 | | | | |
| Promedio | 0,15 | | | | |
| Saldo | 0,14 | | | | |
| Vencimientos de CDR BCRP el 4 de Marzo de 2015 | 3 215,0 | 2 915,0 | 2 915,0 | 2 915,0 | 2 915,0 |
| Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 2 y 6 de Marzo de 2015 | 60,0 | | 60,0 | 60,0 | 60,0 |
| iv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | 400,0 |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Vencimientos de REPO entre el 21 de Setiembre de 2015 | 8 600,0 | 8 600,0 | 8 600,0 | 8 600,0 | 8 600,0 |
| Vencimientos de REPO entre el 2 y 6 de Marzo de 2015 | 300,0 | | 300,0 | 300,0 | 300,0 |
| v. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Vencimientos de REPO el 17 de Enero de 2017 | 1 400,0 | 1 400,0 | 1 400,0 | 1 400,0 | 1 400,0 |
| Vencimientos de REPO entre el 2 y 6 de Marzo de 2015 | 300,0 | | 300,0 | 300,0 | 300,0 |
| vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Vencimientos de REPO entre el 2 y 6 de Marzo de 2015 | 400,0 | 400,0 | 400,0 | 400,0 | 400,0 |
| vii. Subasta de Swap Cambiano Venta del BCRP | | | | | |
| Propuestas recibidas | 300,0 | 300,0 | 300,0 | 300,0 | 300,0 |
| Plazo de vencimiento | 1 090,0 | 895,0 | 1 030,0 | 1 110,0 | 755,0 |
| Tasas de interés: Mínima | 58 d | 88 d | 61 d | 62 d | 66 d |
| Máxima | -0,76 | -0,81 | -1,01 | -1,16 | -0,51 |
| Promedio | -0,51 | -0,81 | -0,67 | -1,07 | -0,20 |
| Saldo | -0,62 | -0,81 | -0,80 | -1,12 | -0,36 |
| Vencimientos de SC-Venta el 2 de Marzo de 2015 | 21 398,4 | 21 098,4 | 21 398,4 | 20 798,5 | 20 798,5 |
| Vencimientos de SC-Venta entre el 2 y 6 de Marzo de 2015 | 1 199,9 | | 1 199,9 | 1 200,0 | 1 200,0 |
| viii. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | | | | | |
| i. Compras (millones de US\$) | | -15,5 | -529,0 | 0,0 | -201,0 |
| ii. Ventas (millones de US\$) | | 5,0 | 170,0 | 65,0 | 3,0930 |
| Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$) | 0,0 | 3,0922 | 3,0944 | 0,0 | 0,0 |
| Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$) - Tesoro Público | | 0,0 | 0,0 | | |
| Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP | | | | | |
| Operaciones de CD BCRP y CD BCRP-NR | | | | | |
| Operaciones de STP | | | | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 2 240,7 | 2 234,2 | 1 912,9 | 1 835,8 | 1 567,4 |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. Comisión temporal de moneda extranjera (tasas) | 0,0114% | 0,0114% | 0,0114% | 0,0114% | 0,0114% |
| b. Comisión temporal directa de valores (fuera de subasta) | | | | | |
| Tasa de interés | 4,05% | 4,05% | 4,05% | 4,05% | 4,05% |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | | |
| Tasa de interés | 4,05% | 4,05% | 4,05% | 4,05% | 4,05% |
| Depósitos Overnight en moneda nacional | 226,8 | 145,2 | 244,2 | 247,6 | 382,3 |
| Tasa de interés | 2,05% | 2,05% | 2,05% | 2,05% | 2,05% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 2 213,9 | 2 059,0 | 1 858,7 | 1 595,2 | 1 185,1 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 9 009,8 | 9 041,7 | 8 935,4 | 8 919,8 | 8 881,5 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 9,4 | 9,5 | 9,3 | 9,3 | 9,3 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 2 762,8 | 2 732,2 | 2 689,6 | 2 602,1 | 2 609,1 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 2,9 | 2,9 | 2,8 | 2,8 | 2,7 |
| 6. Mercado interbancario y mercado monetario de dinero | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 984,0 | 1 449,0 | 1 436,0 | 962,0 | 682,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 3,65/3,70/3,67 | 3,25/3,50/3,28 | 3,25/3,30/3,27 | 3,25/3,30/3,26 | 3,25/3,50/3,31 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 17,2 | 8,6 | 7,0 | 16,0 | 16,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 0,20/0,20/0,20 | 0,20/0,20/0,20 | 0,15/0,15/0,15 | 0,0 | 0,15/0,15/0,15 |
| c. Total mercado secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y CDV | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 10,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | 100,0 / 3,10 | | | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 20 Febrero 15 | 23 Febrero 15 | 24 Febrero 15 | 25 Febrero 15 | 26 Febrero 15 |
| Flujo de la posición global = a + b + c + e + f | 20,4 | -3,6 | -15,2 | 18,5 | 13,8 |
| Flujo de la posición contable = a + b + c - d + e + f | -14,1 | -67,9 | -52,1 | 347,6 | 89,4 |
| a. Mercado spot con el público | -178,6 | -240,9 | -63,0 | 22,8 | -111,8 |
| i. Compras | 343,0 | 318,6 | 361,3 | 518,7 | 469,3 |
| ii. (-) Ventas | 521,6 | 559,5 | 424,2 | 495,9 | 581,1 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | -11,3 | -108,4 | 40,5 | -224,7 | -133,0 |
| i. Paquetadas | 176,8 | 156,7 | 285,1 | 191,2 | 138,1 |
| ii. (-) Vencidas | 188,1 | 268,0 | 245,7 | 415,9 | 271,0 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 51,4 | -180,4 | 42,9 | 35,4 | -57,4 |
| i. Paquetadas | 91,3 | 198,7 | 249,2 | 583,3 | 212,6 |
| ii. (-) Vencidas | 39,9 | 379,0 | 206,4 | 547,8 | 270,0 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 690,0 | 666,0 | 627,5 | 829,0 | 448,0 |
| ii. A futuro | 15,0 | 0,0 | 20,0 | 0,0 | 57,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forward sin entrega | | | | | |
| i. Compras | 37,0 | 376,7 | 206,1 | 547,5 | 237,6 |
| ii. (-) Ventas | 30,1 | 147,4 | 131,5 | 252,0 | 37,9 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | 106,5 | 47,0 | -203,7 | 258,3 | 0,4 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec) | 3,0872 | 3,0913 | 3,0934 | 3,0952 | 3,0921 |
| 17 Usado preliminar | | | | | |