

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Sol)

	19 Octubre 15	20 Octubre 15	21 Octubre 15	22 Octubre 15	23 Octubre 15
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>4 374.4</b>	<b>4 566.9</b>	<b>4 177.6</b>	<b>3 844.2</b>	<b>3 433.6</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	50.0		50.0	50.0	200.0
Plazo de vencimiento	183.6		130.0	119.0	223.0
Tasas de interés: Mínima	171.4		523.4	92.4	91.4
Máxima	4.20		4.50	4.40	4.25
Promedio	4.20		4.61	4.36	4.50
Saldo	17 168.0	17 168.0	17 418.0	17 688.0	17 688.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 5 de Noviembre de 2015	375.0		375.0		375.0
Vencimiento de CD BCRP entre el 26 y el 30 de Octubre de 2015	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	450.0	450.0	450.0	450.0	450.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 23 de Diciembre de 2015	150.0		150.0		150.0
Vencimiento de REPO BCRP entre el 26 y el 30 de Octubre de 2015	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	2 284.0	2 284.0	2 284.0	2 284.0	2 284.0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 24 de Octubre de 2015	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 26 y el 30 de Octubre de 2015	0.0		0.0		0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1000.0	1 882.7	1 385.4	1 116.6	1 989.9
Plazo de vencimiento	1197.8	1 607.5	1 385.4	1 116.6	2 488.2
Tasas de interés: Mínima	1.4	1.4	1.4	1.4	1.4
Máxima	3.45	3.48	3.45	3.45	3.30
Promedio	3.50	3.50	3.50	3.50	3.50
Saldo	3 491.3	3 479.6	3 491.3	3 491.3	3 491.3
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 26 de Octubre de 2015	3 391.7	3 276.6	3 391.7	3 391.7	3 391.7
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 26 y el 30 de Octubre de 2015	3 391.7		3 391.7		3 391.7
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 049.9	3 049.9	3 049.9	3 049.9	3 049.9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 27 de Noviembre de 2015	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 26 y el 30 de Octubre de 2015	0.0		0.0		0.0
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
Vencimiento de Coloc - BN entre el 26 y el 30 de Octubre de 2015	0.0		0.0		0.0
vii. Subasta de Certificados de Depósitos Rescatables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 305.6	6 365.6	6 365.6	6 365.6	6 365.6
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 26 de octubre de 2015	282.0		300.0		300.0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 26 y el 30 de Octubre de 2015	282.0		0.0		1 150.4
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	15 950.0	15 950.0	15 950.0	15 950.0	15 950.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 28 de Octubre de 2015	900.0		900.0		900.0
Vencimiento de REPO entre el 26 y el 30 de Octubre de 2015	0.0		0.0		0.0
ix. 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 Exansión el 17 de Enero de 2017	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de REPO Exansión entre el 26 y el 30 de Octubre de 2015	0.0		0.0		0.0
x. 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
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 26 y el 30 de Octubre de 2015	0.0		0.0		0.0
xi. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	600	300	600	200	300
Plazo de vencimiento	1640	420	750	100	327
Tasas de interés: Mínima	0.15	0.15	0.18	0.11	0.50
Máxima	0.29	0.15	0.35	0.11	0.75
Promedio	0.24	0.15	0.26	0.11	0.68
Saldo	22 866.4	23 986.4	23 986.4	22 886.4	22 886.4
Próximo vencimiento de SC-Venta el 26 de Octubre de 2015	600.0		600.0		600.0
Vencimiento de SC - Venta entre el 26 y el 30 de Octubre de 2015	2 725.0		2 725.0		2 725.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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>1 441.7</b>	<b>1 290.3</b>	<b>1 115.6</b>	<b>1 694.3</b>	<b>925.1</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (base efectiva diaria)	0.0108%	0.0108%	0.0108%	0.0108%	0.0108%
b. Compra 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%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	2.95%	2.95%	2.95%	2.95%	2.95%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>1 182.4</b>	<b>959.4</b>	<b>884.6</b>	<b>1 202.5</b>	<b>692.3</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	7 200.0	7 250.0	7 080.9	6 710.0	6 211.4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.6	7.6	7.4	7.1	7.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 304.5	2 231.0	2 167.0	2 068.4	2 005.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.4	2.5	2.3	2.2	2.1
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 150.5	806.5	975.5	870.0	784.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,503,503,50	3,503,503,50	3,503,503,52	3,503,503,50	3,503,503,58
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	294.0	342.0	197.0	205.0	205.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,400,400,40	0,400,400,40	0,300,300,30	0,200,200,20	0,200,200,20
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	98.4	0.0	0.0	80.0	0.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	48,444.20				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>16 Octubre 15</b>	<b>19 Octubre 15</b>	<b>20 Octubre 15</b>	<b>21 Octubre 15</b>	<b>22 Octubre 15</b>
Flujo de la posición global - a + b + c + e + f + g	62.0	-84.6	9.1	-150.8	20.1
Flujo de la posición contable - a + b + c - d + e + f + g	59.2	-6.5	-75.0	-60.1	-8.3
a. Mercado spot con el público	35.8	-12.2	-128.7	-150.8	-57.4
i. Compras	292.3	216.4	206.0	241.6	220.1
ii. (i) Ventas	246.6	228.6	334.6	392.3	277.6
b. Compras forward al público (con y sin entrada)	-8.8	13.5	126.4	100.5	-4.8
i. Paquetes	133.5	279.9	236.4	220.2	120.1
ii. (i) Vencidas	142.2	257.4	109.0	119.7	125.0
c. Ventas forward al público (con y sin entrada)	-21.2	131.1	81.2	230.7	-144.2
i. Paquetes	213.1	278.7	203.5	372.8	188.6
ii. (i) Vencidas	234.3	147.6	122.3	137.1	332.7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	227.5	185.5	481.0	988.2	580.5
ii. A futuro	0.0	0.0	0.0	0.0	14.0
e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrada	206.8	-4.4	83.7	85.7	297.0
f. Compras	234.1	145.1	95.8	120.0	331.5
g. (i) Ventas	27.3	149.5	12.1	34.5	
h. Efecto de Divisas	12.5	43.7	18.5	49.2	48.7
i. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-113.5	-104.0	-40.6	-26.8	-197.8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Igual por regulación monetaria en moneda extranjera					
ii. Efecto de Divisas					
iii. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
iv. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
iii. Efecto de Divisas					
iv. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
v. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
iii. Efecto de Divisas					
iv. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
v. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
iii. Efecto de Divisas					
iv. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
v. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
iii. Efecto de Divisas					
iv. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
v. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
iii. Efecto de Divisas					
iv. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
v. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
iii. Efecto de Divisas					
iv. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
v. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
iii. Efecto de Divisas					
iv. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
v. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
iii. Efecto de Divisas					
iv. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
v. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
iii. Efecto de Divisas					
iv. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
v. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
iii. Efecto de Divisas					
iv. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
v. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
iii. Efecto de Div					