

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

	Millones de Nuevos Soles				
	8 Febrero 16	9 Febrero 16	10 Febrero 16	11 Febrero 16	12 Febrero 16
	4 146,5	4 414,7	4 764,6	6 238,6	6 533,1
<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	100,0	200,0	30,1	80
Propuestas recibidas	118,0	170,1	256,0	83,1	438
Plazo de vencimiento	185,4	94,4	93,4	364,4	50,4
Tasas de interés: Mínima	4,50	4,08	4,24	4,12	4,49
Máxima	4,50	4,25	4,40	5,10	4,45
Promedio	4,50	4,25	4,31	5,10	4,45
Saldo	16 091,5	16 291,5	16 291,5	15 883,3	16 143,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 22 de Febrero de 2016	1 050,0			1 050,0	48,0
Vencimiento de CD BCRP entre el 15 y el 19 de Febrero de 2016	500,8			500,8	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				
Vencimiento de REPO BCRP entre el 15 y el 19 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	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0	1 600,0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 26 de Febrero de 2016	500,8			500,8	0,0
Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 15 y el 19 de Febrero de 2016	0,0			0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	499,8	899,9	1 111,2	677,9	2 281,0
Propuestas recibidas	791,5	1 282,3	1 071,5	1 111,2	1 000,0
Plazo de vencimiento	1,4	1,4	1,4	1,4	3,4
Tasas de interés: Mínima	3,95	3,92	3,97	3,98	3,99
Máxima	4,00	4,00	3,99	4,00	4,00
Promedio	3,97	3,97	3,97	3,97	3,97
Saldo	1 399,7	1 700,2	1 611,2	2 268,9	4 117
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 12 de Febrero de 2016	1 399,7				4 000,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 15 y el 19 de Febrero de 2016	1 399,7				4 000,0
v. 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	550,0				550,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 15 y el 19 de Febrero de 2016	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
Vencimiento de Coloc - BN entre el 15 y el 19 de Febrero de 2016	0,0				0,0
vii. Subasta de Certificados de Depósitos Rescatables del BCRP (CDR BCRP)	50,0	104,0	222,0	50,0	100,0
Propuestas recibidas	50,0	104,0	222,0	100,0	150,0
Plazo de vencimiento	91,4	60,4	62,4	90,4	70,0
Tasas de interés: Mínima	0,75	0,75	0,75	0,74	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	7 744,6	8 066,6	7 880,6	7 840,6	7 540,6
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 22 de Febrero de 2016	426,0				488,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 15 y el 19 de Febrero de 2016	626,0				0,0
ix. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Regular)					
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
Vencimiento de REPO Regular entre el 15 y el 19 de Febrero de 2016	0,0				0,0
x. Compra con compromiso de Reconpra 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
Vencimiento de REPO Exansión entre el 15 y el 19 de Febrero de 2016	0,0				0,0
xi. Compra con compromiso de Reconpra 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
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 15 y el 19 de Febrero de 2016	0,0				0,0
xii. Subasta de Swap Cambiario Vertes del BCRP	157,2	139,0	88,0	100,0	120,0
Propuestas recibidas	157,2	139,0	88,0	200,0	150,0
Plazo de vencimiento	91,4	60,4	62,4	90,4	70,0
Tasas de interés: Mínima	0,75	0,75	0,75	0,74	0,75
Máxima	0,75	0,75	0,75	0,75	0,75
Promedio	0,75	0,75	0,75	0,74	0,75
Saldo	31 101,6	30 986,6	31 184,6	31 261,6	31 281,6
Próximo vencimiento de SC-Vertes el 16 de Febrero de 2016	303,0				309,0
Vencimiento de SC - Vertes entre el 15 y el 19 de Febrero de 2016	983,0				340,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-58,4	-210,2	-280,6	-316,3	-21,0
i. Compras (millones de US\$)					
ii. Ventas (millones de US\$)	17,0	60,0	80,0	90,0	6,0
Tipo de cambio promedio	3,4949	3,5030	3,5081	3,5143	3,5065
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>2 460,4</b>	<b>1 982,3</b>	<b>2 375,0</b>	<b>2 883,3</b>	<b>1 632,0</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (base efectiva diaria)	0,0129%	0,0129%	0,0129%	0,0129%	0,0119%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	4,30%	4,30%	4,30%	4,55%	4,80%
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,56%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	66,0	3,0	2,9	0,0	23,6
Tasa de interés	2,75%	2,75%	2,75%	2,75%	3,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2 337,4	1 979,3	2 372,1	2 883,3	1 608,4
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>2 337,4</b>	<b>1 979,3</b>	<b>2 372,1</b>	<b>2 883,3</b>	<b>1 608,4</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8,0	7,9	7,7	7,6	7,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (1)	2 850,3	2 798,0	2 721,1	2 643,0	2 566,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,8	2,8	2,7	2,7	2,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (1)					
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 004,8	872,8	764,8	634,0	1 313,4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,004/4,04/4,00	4,004/4,04/4,00	4,004/4,04/4,00	4,004/4,04/4,00	4,25/4,24/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	193,0	320,0	300,0	282,0	245,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,380/3,90/3,88	0,380/3,90/3,88	0,380/3,90/3,88	0,380/3,90/3,88	0,380/3,90/3,88
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	71,7	110,2	102,0	128,0	72,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	50,1/4,90				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	21,7/4,50				
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>05 Febrero 16</b>	<b>08 Febrero 16</b>	<b>09 Febrero 16</b>	<b>10 Febrero 16</b>	<b>11 Febrero 16</b>
Flujo de la posición global = a + b + c + e + f + g	78,1	-13,0	-33,3	-13,4	122,2
Flujo de la posición contable = a + b + d - c + e + f + g	-40,4	73,8	147,3	91,3	51,6
a. Mercado spot con el público	-42,5	21,8	-43,3	-34,9	-34,9
i. Compras	218,2	195,5	170,0	190,0	190,0
ii. (i) Ventas	260,6	173,7	256,3	214,2	185,6
ii. (ii) Paquetes	115,1	-13,3	-22,0	-30,8	-105,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	174,2	78,9	98,5	116,6	90,1
ii. (i) Ventadas	227,1	92,2	120,5	226,5	158,4
ii. (ii) Ventadas	2,6	82,9	117,2	73,0	-138,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias	224,5	231,5	291,1	215,4	203,3
ii. Al contado	604,0	655,0	686,0	899,0	374,7
ii. A futuro	0,0	13,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	222,7	166,7	47,8	168,9	168,9
i. Compras	224,2	209,5	173,6	140,6	329,9
ii. (i) Ventas	1,5	42,8	92,8	92,8	173,0
f. Efecto de Divisas	8,4	8,8	3,4	5,7	5,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-57,7	35,1	109,5	101,1	101,1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Igual a regulación monetaria en moneda extranjera					
ii. Efecto de Divisas					
iii. Tasa de interés					
iv. Efecto de Divisas					
v. Tasa de interés					
vi. Efecto de Divisas					
vii. Tasa de interés					
viii. Efecto de Divisas					
ix. Tasa de interés					
x. Efecto de Divisas					
xi. Tasa de interés					
xii. Efecto de Divisas					
xiii. Tasa de interés					
xiv. Efecto de Divisas					
xv. Tasa de interés					
xvi. Efecto de Divisas					
xvii. Tasa de interés					
xviii. Efecto de Divisas					
xix. Tasa de interés					
xx. Efecto de Divisas					
xxi. Tasa de interés					
xxii. Efecto de Divisas					
xxiii. Tasa de interés					
xxiv. Efecto de Divisas					
xxv. Tasa de interés					
xxvi. Efecto de Divisas					
xxvii. Tasa de interés					
xxviii. Efecto de Divisas					
xxix. Tasa de interés					
xxx. Efecto de Divisas					
xxxi. Tasa de interés					
xxxii. Efecto de Divisas					
xxxiii. Tasa de interés					
xxxiv. Efecto de Divisas					
xxxv. Tasa de interés					
xxxvi. Efecto de Divisas					
xxxvii. Tasa de interés					
xxxviii. Efecto de Divisas					
xxxix. Tasa de interés					
xl. Efecto de Divisas					
xli. Tasa de interés					
xlii. Efecto de Divisas					
xliiii. Tasa de interés					
xliiii. Efecto de Divisas					