

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	15 Febrero 16	16 Febrero 16	17 Febrero 16	18 Febrero 16	19 Febrero 16
	8 446,1	6 111,2	3 686,9	3 448,7	1 648,2
<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)					
Propuestas recibidas	211	30	108	34	30
Plazo de vencimiento	376	176	346	201	90
Tasas de interés: Mínima	85,4	178,4	178,4	87,4	540,4
Máxima	4,45	4,70	4,78	4,55	5,22
Promedio	4,55	4,76	4,80	4,56	5,22
Saldo	4,51	4,74	5,00	4,55	5,17
Próximo vencimiento de CD BCRP el 22 de Febrero de 2016	16 498,3		16 726,3	16 875,3	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	48,0		48,0	48,0	
Plazo de vencimiento	0,0		0,0	0,0	
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	
iii. Vencimiento de REPO BCRP entre el 22 y el 26 de Febrero de 2016	0,0		0,0	0,0	
iv. 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	500,8	
v. Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 22 y el 26 de Febrero de 2016	0,0		0,0	0,0	
vi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	999,9	2000,1	1000,1	1000,0	500,0
Plazo de vencimiento	2634,2	2967,4	1863,3	1840,7	603,0
Tasas de interés: Mínima	1,4	1,4	1,4	1,4	3,4
Máxima	4,10	3,99	4,10	4,19	4,15
Promedio	4,24	4,23	4,23	4,23	4,25
Saldo	3 600,0	2 623,3	2 500,2	2 500,2	887,3
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 22 de Febrero de 2016	3 600,0		2 500,2	2 500,2	
vii. Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 22 y el 26 de Febrero de 2016	3 600,0		2 500,2	2 500,2	
viii. 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	2 500,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 26 de Febrero de 2016	550,0		550,0	550,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP entre el 22 y el 26 de Febrero de 2016	0,0		0,0	0,0	300,0
ix. 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 Mayo de 2016	300,0		300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Coloc - BN entre el 22 y el 26 de Febrero de 2016	0,0		0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Certificados de Depósitos Rescatables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas		300,0	320,0	150,0	100,0
Plazo de vencimiento		90,4	82,4	90,4	90,4
Tasas de interés: Mínima		0,69	0,69	0,70	0,75
Máxima		0,69	0,70	0,70	0,75
Promedio		0,69	0,70	0,72	0,75
Saldo	7 540,6	8 360,6	8 360,6	8 360,6	8 110,6
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 22 de Febrero de 2016	488,0		488,0	488,0	488,0
Vencimiento de CDR BCRP entre el 22 y el 26 de Febrero de 2016	0,0		0,0	0,0	788,0
xi. 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
Vencimiento de Repo Regular entre el 22 y el 26 de Febrero de 2016	0,0		0,0	0,0	0,0
xii. 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	300,0
Vencimiento de REPO Exansión entre el 22 y el 26 de Febrero de 2016	0,0		0,0	0,0	0,0
xiii. 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
Vencimiento de REPO Sustitución entre el 22 y el 26 de Febrero de 2016	0,0		0,0	0,0	470,0
xiv. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas		400,0		295	290
Plazo de vencimiento		750,0		900	634
Tasas de interés: Mínima		121,4		90,4	90,4
Máxima		0,74		0,75	0,74
Promedio		0,74		0,75	0,74
Saldo	31 261,6	31 301,7	31 001,7	30 946,7	31 191,7
Próximo vencimiento de SC-Venta el 22 de Febrero de 2016	369,9		600,0	600,0	600,0
Vencimiento de SC - Venta entre el 22 y el 26 de Febrero de 2016	1 924,9		860,0	860,0	2 540,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	-203,6	0,0	-45,6	-94,9
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)		58,0	13,0	27,0	27,0
Tipo de cambio promedio		3,5101	3,5068	3,5146	3,5146
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					
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>1 491,1</b>	<b>1 236,3</b>	<b>1 067,7</b>	<b>1 036,1</b>	<b>766,6</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%	0,0129%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	4,80%	4,80%	5,30%	5,30%	5,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	48,0	9,7	37,6	36,4	6,0
Tasa de interés	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>1 442,1</b>	<b>1 226,3</b>	<b>1 067,7</b>	<b>1 036,1</b>	<b>766,6</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (Millones de S/)	7 375,3	7 696,3	7 696,3	7 391,3	7 278,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,8	7,5	7,3	7,2	7,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (Millones de S/)	2 252,8	2 372,0	2 304,6	2 237,2	2 199,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,4	2,4	2,3	2,2	2,1
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 382,0	1 269,0	1 484,0	1 887,0	1 460,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,254/2,04/2,25	4,254/2,04/2,25	4,254/4,04/3,11	4,255/3,05/2,67	5,005/3,05/2,20
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	202,0	145,0	160,0	132,0	7,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,380/3,80/3,38	0,380/3,80/3,38	0,380/3,80/3,38	0,380/3,80/3,38	0,380/3,80/3,38
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	166,4	70,0	100,0	30,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			100,0 / 5,0		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				30,0 / 5,05	
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>12 Febrero 16</b>	<b>15 Febrero 16</b>	<b>16 Febrero 16</b>	<b>17 Febrero 16</b>	<b>18 Febrero 16</b>
Flujo de la posición global - a + b + c + e + f + g	-196,3	-103,6	184,3	-107,9	71,1
Flujo de la posición contable - a + b + c + d + e + f + g	-168,3	-69,8	206,8	-29,1	31,6
a. Mercado spot con el público	-103,7	-78,0	-129,2	-61,7	-61,7
i. Compras	226,9	149,6	191,0	187,4	209,3
ii. (i) Ventas	329,6	227,7	310,2	229,6	271,0
Compras forward al público (con y sin entrega)	34,5	33,4	7,9	13,4	-13,8
i. Paquetes	48,2	59,8	87,0	83,0	104,7
ii. (i) Vencidas	82,7	26,3	75,1	69,7	218,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	27,7	74,6	46,2	1,1	-143,7
i. Paquetes	111,9	106,0	152,1	362,2	244,4
ii. (i) Vencidas	139,6	31,4	145,8	301,1	388,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
Al contado	611,4	677,3	1230,2	732,0	804,7
Al futuro	30,0	12,0	3,0	16,5	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	87,0	22,0	112,4	251,3	208,8
f. Compras	129,3	24,3	138,3	284,7	385,1
i. (i) Ventas	42,3	0,8	27,9	33,4	178,3
ii. Efecto de Docenas	1,8	2,6	9,4	9,4	32,8
o. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-114,6	1,8	-298,8	-96,3	32,9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota legal por regulación monetaria (Fuente: Dineco)					
N) Efecto de Docenas	3,5077	3,5000	3,5086	3,5039	3,5040