

| BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU | | | | | | |
|--|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS | | | | | | |
| (Millones de Soles) | | | | | | |
| | 11 Abril 16 | 12 Abril 16 | 13 Abril 16 | 14 Abril 16 | 15 Abril 16 | |
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP | 3 997,9 | 5 136,1 | 5 766,3 | 5 898,8 | 3 579,4 | |
| 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 | 30,1 | 200,1 | 300 | 300 | 500 | 300 |
| Plazo de vencimiento | 207,5 | 478,0 | 457 | 547 d | 364 d | 941 |
| Tasas de Inter Mínima | 178 d | 360 d | 359 d | 547 d | 364 d | 539 d |
| Tasas de Inter Máxima | 4,50 | 4,64 | 4,68 | 4,97 | 4,85 | 4,80 |
| Tasas de Inter Promedio | 4,55 | 4,85 | 4,95 | 4,99 | 4,90 | 4,85 |
| Saldo | 15 139,1 | 4,74 | 4,82 | 4,98 | 4,70 | 4,84 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Mayo de 2016 | | | 15 639,1 | 15 675,2 | 15 505,2 | 16 305,2 |
| Vencimiento de CD BCRP entre el 10 y el 22 de Abril de 2016 | | | | | | 612,0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | | | | | | 0,0 |
| Propuestas recibidas | | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | | |
| Tasas de Inter Máxima | | | | | | |
| Tasas de Inter Promedio | | | | | | |
| Saldo | 800,0 | 500,0 | 500,0 | 500,0 | 500,0 | 500,0 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 26 de mayo de 2016 | | | | | | 500,0 |
| Vencimiento de REPO BCRP entre el 18 y el 22 de Abril de 2016 | | | | | | 0,0 |
| iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR) | | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | | |
| Tasas de Inter Máxima | | | | | | |
| Tasas de Inter Promedio | | | | | | |
| Saldo | 1 600,0 | 1 600,0 | 1 600,0 | 1 600,0 | 1 600,0 | 1 600,0 |
| Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR el 26 de Mayo de 2016 | | | | | | 400,0 |
| Vencimiento de Repo Especial - CDR entre el 18 y el 22 de Abril de 2016 | | | | | | 0,0 |
| iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP) | | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | | |
| Tasas de Inter Máxima | | | | | | |
| Tasas de Inter Promedio | | | | | | |
| Saldo | 160,0 | 160,0 | 160,0 | 160,0 | 160,0 | 160,0 |
| Próximo vencimiento de CDV BCRP el 20 mayo de 2016 | | | | | | 160,0 |
| Vencimientos de CDV BCRP entre el 18 y el 22 de Abril de 2016 | | | | | | 0,0 |
| v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | | | | | | |
| Propuestas recibidas | 500,0 | 1 600,0 | 2 000,0 | 1 999,9 | | |
| Plazo de vencimiento | 844,6 | 1 758,2 | 3 065,9 | 2 872,7 | | |
| Tasas de Inter Mínima | 1 d | 1 d | 1 d | 1 d | | |
| Tasas de Inter Máxima | 4,00 | 4,00 | 4,22 | 4,10 | | |
| Tasas de Inter Promedio | 4,19 | 4,25 | 4,19 | 4,20 | | |
| Saldo | 500,0 | 1 600,0 | 2 000,0 | 1 999,9 | | |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el | | | | | | |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo entre el 18 y el 22 de Abril de 2016 | | | | | | |
| vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público | | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | | |
| Tasas de Inter Máxima | | | | | | |
| Tasas de Inter Promedio | | | | | | |
| Saldo | 2 500,0 | 2 500,0 | 2 500,0 | 2 500,0 | 2 500,0 | 2 500,0 |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 13 Mayo de 2016 | | | | | | 300,0 |
| Vencimiento de Coloc-TP entre el 18 y el 22 de Abril de 2016 | | | | | | 0,0 |
| vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación | | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | | |
| Tasas de Inter Máxima | | | | | | |
| Tasas de Inter Promedio | | | | | | |
| Saldo | 600,0 | 600,0 | 600,0 | 600,0 | 600,0 | 600,0 |
| Próximo vencimiento de Coloc-BN el 20 Mayo de 2016 | | | | | | 300,0 |
| Vencimiento de Coloc - BN entre el 18 y el 22 de Abril de 2016 | | | | | | 0,0 |
| viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP) | | | | | | |
| Propuestas recibidas | | 165,0 | 55,0 | 165,0 | | |
| Plazo de vencimiento | | 91 d | 91 d | 91 d | | |
| Tasas de Inter Mínima | | 0,59 | 0,74 | 0,74 | | |
| Tasas de Inter Máxima | | 0,59 | 0,74 | 0,74 | | |
| Tasas de Inter Promedio | | 0,59 | 0,74 | 0,74 | | |
| Saldo | 7 230,0 | 6 795,0 | 6 350,0 | 6 285,0 | 6 285,0 | 6 285,0 |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP el 18 de Abril de 2016 | | | | | | 520,0 |
| Vencimiento de CDR BCRP entre el 18 y el 22 de Abril de 2016 | | | | | | 1 020,0 |
| ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular) | | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | | |
| Tasas de Inter Máxima | | | | | | |
| Tasas de Inter Promedio | | | | | | |
| Saldo | 16 200,0 | 16 200,0 | 16 200,0 | 16 200,0 | 16 200,0 | 15 600,0 |
| Próximo vencimiento de Repo Regular el 2 de Mayo de 2016 | | | | | | 300,0 |
| Vencimiento de REPO entre el 18 y el 22 de Abril de 2016 | | | | | | 0,0 |
| x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión) | | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | | |
| Tasas de Inter Máxima | | | | | | |
| Tasas de Inter Promedio | | | | | | |
| Saldo | 7 900,0 | 7 900,0 | 7 900,0 | 7 900,0 | 7 900,0 | 7 900,0 |
| Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017 | | | | | | 300,0 |
| Vencimiento de REPO Expansión entre el 18 y el 22 de Abril de 2016 | | | | | | 0,0 |
| xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución) | | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | | |
| Tasas de Inter Mínima | | | | | | |
| Tasas de Inter Máxima | | | | | | |
| Tasas de Inter Promedio | | | | | | |
| Saldo | 4 804,7 | 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 |
| Vencimiento de REPO Sustitución entre el 18 y el 22 de Abril de 2016 | | | | | | 0,0 |
| xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | | 105,0 | 190,0 | 95,0 | 330,0 | 330,0 |
| Propuestas recibidas | | 290,0 | 229,0 | 256,0 | 330,0 | 330,0 |
| Plazo de vencimiento | | 91 d |
| Tasas de Inter Mínima | | 0,49 | 0,40 | 0,65 | 0,50 | 0,75 |
| Tasas de Inter Máxima | | 0,49 | 0,74 | 0,69 | 0,70 | 0,75 |
| Tasas de Inter Promedio | | 0,49 | 0,69 | 0,59 | 0,70 | 0,75 |
| Saldo | 24 122,1 | 23 881,8 | 23 682,8 | 23 493,8 | 22 099,2 | 22 099,2 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 19 de Abril de 2016 | | | | | | 335,0 |
| Vencimiento de SC - Venta entre el 18 y el 22 de Abril de 2016 | | | | | | 1 862,0 |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | | | | | | 0,0 |
| i. Compras (millones de US\$) | | | | | | |
| 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 | | | | | | |
| 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 | 0,0 |
| ii. Compras de BTP | | | | | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 3 267,7 | 2 871,1 | 3 081,3 | 2 868,9 | 2 779,4 | |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps) | | | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0137% | 0,0138% | 0,0138% | 0,0138% | 0,0128% | |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | | | | | | |
| Tasa de interés | 4,80% | 4,80% | 4,80% | 4,80% | 4,80% | |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | 4,80% | 4,80% | 4,80% | 4,80% | 4,80% | |
| Tasa de interés | 3,16,0 | 27,1 | 147,1 | 12,0 | 930,5 | |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 3,00% | 3,00% | 3,00% | 3,00% | 3,00% | |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 2 951,7 | 2 844,0 | 2 934,2 | 2 856,9 | 1 848,9 | |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 4 295,8 | 4 295,8 | 4 295,8 | 4 295,8 | 4 295,8 | |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 7,8 | 7,8 | 7,8 | 7,8 | 7,7 | |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 2 787,0 | 2 876,0 | 2 875,1 | 2 879,7 | 2 811,0 | |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 2,7 | 2,7 | 2,8 | 2,8 | 2,7 | |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 1 466,0 | 1 419,0 | 1 619,0 | 1 687,0 | 1 693,0 | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,25/4,20/4,25 | 4,25/4,20/4,25 | 4,25/4,20/4,25 | 4,25/4,20/4,25 | 4,25/4,20/4,25 | |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 306,0 | 311,0 | 311,0 | 178,0 | 178,0 | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 0,38 / 0,43 / 0,39 | 0,38 / 0,43 / 0,39 | 0,38 / 0,43 / 0,39 | 0,38 / 0,38 / 0,38 | 0,38 / 0,38 / 0,38 | |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV | 0,0 | 0,0 | 40,0 | 119,0 | 43,0 | |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | | 23 / 4,85 | 23 / 4,70 | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | 96 / 4,90 | 23 / 4,70 | |
| Plazo 18 meses (monto / tasa promedio) | 8,0 / 5,25 | 8,0 / 5,25 | 8,0 / 5,25 | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 08 abril 16 | 11 abril 16 | 12 abril 16 | 13 abril 16 | 14 abril 16 | 14 abril 16 |
| Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g | -263,2 | -229,2 | -30,3 | -21,9 | 147,4 | |
| Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g | -134,3 | -173,3 | -173,3 | -120,4 | 60,7 | |
| a. Mercado spot con el público | | | | | | |
| i. Compras | 236,9 | 216,2 | 216,2 | 216,2 | 73,9 | |
| ii. (f) Ventas | 260,3 | 276,6 | 246,0 | 289,4 | 300,9 | |
| Compras forward al público (con y sin entrega) | 65,3 | 65,5 | 76,2 | 69,7 | 227,0 | |
| i. Pactadas | 141,1 | 160,1 | 155,7 | 220,0 | 158,5 | |
| ii. (c) Ventas | 55,8 | 104,6 | 75,4 | 250,7 | 180,1 | |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | -76,3 | -162,9 | -189,8 | -156,4 | -156,4 | |
| i. Pactadas | 126,1 | 158,9 | 66,6 | 174,9 | 231,9 | |
| ii. (c) Ventas | 202,4 | 181,5 | 234,5 | 384,7 | 389,2 | |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | | |
| i. Al contado | 792,2 | 793,3 | 1026,1 | 1026,1 | 795,7 | |
| ii. A futuro | 156,6 | 10,0 | 15,0 | 5,0 | 0,0 | |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | | | | | | |
| i. Compras | 195,2 | 71,8 | 161,7 | 120,8 | 212,6 | |
| ii. (c) Ventas | 28,8 | 67,4 | 66,9 | 243,3 | 384,9 | |
| f. Efecto de Opciones | -2,3 | -4,1 | -1,0 | -5,2 | 6,9 | |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -408,9 | -201,9 | -188,8 | -181,4 | -72,6 | |
| h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | | | | | | |
| (*) Datos preliminares | 3,3867 | 3,2892 | 3,2896 | 3,2697 | 3,2709 | |