



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 28 de septiembre de 2012

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 13 750

El monto considera las subastas realizadas antes del mediodía.

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	DP-591	CD-3597	CD-3598	DP-592
Monto Subasta	3 000,0	100,0	100,0	3 500,0
Plazo	Overnight	9 Meses	18 meses	Overnight
Emisión	28-sep-12	28-sep-12	28-sep-12	28-sep-12
Vencimiento	03-oct-12	11-jul-13	13-mar-14	03-oct-12
Plazo en días	5	286	531	5
Hora cierre	10:30	13:10	13:20	14:00
Participantes	G-1	G-3	G-3	G-1
Montos				
Demandado	4 468,0	320,0	243,9	2 769,3
Aceptado	3 000,1	100,0	100,0	2 769,3
Tasas (%)				
Mínima	4,20	3,93	3,98	4,15
Máxima	4,22	3,95	4,02	4,22
Promedio	4,21	3,93	4,00	4,17
Precio (%)				
Mínimo		96,9700	94,3523	
Máximo		96,9840	94,4060	
Promedio		96,9815	94,3795	

III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

Operación	Monto	TC promedio
Compra	40,0	2,5978

IV. OPERACIONES DE VENTANILLA

Operación	Monto	Tasa
	Sin movimiento	

Las tasas de interés de las operaciones activas y pasivas en moneda nacional del BCRP con el sistema financiero efectuadas fuera de subasta son las publicadas en la Nota Informativa del [Programa Monetario de Septiembre de 2012](#).

En la compra directa temporal de títulos valores se aceptarán los indicados en la **Circular N° 016-2012-BCRP**. Las solicitudes deberán ser enviadas al Departamento de Operaciones Monetarias y Cambiarias vía facsímil hasta las 17:30 hrs.

El BCRP podrá establecer montos máximos de compra directa de valores. El BCRP se reserva el derecho de rechazar, sin expresión de causa, las solicitudes que se presenten.

V. DEPÓSITOS OVERNIGHT

Moneda	Monto	Tasas
Nacional (S/.)	732,0	3,45
Extranjera (US\$)	649,1	0,1759

VI. SALDO DE CERTIFICADOS Y DEPÓSITOS BCRP (En Nuevos Soles)

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	5 769,4	Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito	CD	19 689,6	Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)
Certificado de Depósito Reajutable	CDR	0,0	Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)
Certificado de Depósito Tasa Variable	CDV	0,0	Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito Liquidable en US\$	CDLD	0,0	Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)
TOTAL		25 459,0	

VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE NUEVOS SOLES

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Repo para provisión de Nuevos Soles	REP	0,0	Circular 016-2012-BCRP (20/06/2012)

VIII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE USD

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Repo para provisión de USD	RED	0,0	Circular 012-2011-BCRP (28/04/2011)

IX. INFORMES

Departamento de Operaciones Monetarias y Cambiarias

Teléfonos 613-2000 Anexos: 4521, 4561, 4527
Facsímil 613-2534

NOTAS:

- 1/ El Grupo 1 (G-1) incluye a las empresas de operaciones múltiples autorizadas a captar depósitos del público, según Art. 16 Ley 26702.
- 2/ El Grupo 2 (G-2) incluye a las empresas de operaciones múltiples autorizadas a captar depósitos del público, según Art. 16 Ley 26702 y sociedades administradoras de fondos mutuos.
- 3/ El Grupo 3 (G-3) Incluye a las entidades autorizadas mediante Circular 013-2012-BCRP.
- 4/ El Grupo 4 (G-4) incluye a las empresas bancarias, según Art. 16 Ley 26702.
- 5/ El Grupo 5 (G-5) incluye a las empresas de operaciones múltiples autorizadas a captar depósitos del público, según Art. 16 Ley 26702, sociedades administradoras de fondos mutuos y administradoras de fondos de pensiones.
- 6/ El Grupo 6 (G-6) incluye a las entidades autorizadas mediante Circulares 015-2006-BCRP y 045-2008-BCRP.
- 7/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.