

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 14 de enero de 2016  
Cifras en millones y tasas en porcentajes

## I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 4 850

## II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	SCV-504	CDR-408	DP-1106	CD-4414	SWAP-189	CD-4415	CD-4416	DP-1107
Monto Subasta	600,0	100,0	1 500,0	30,0	300,0	200,0	200,0	2 900,0
Plazo	3 meses	3 meses	O/N	1 año	2 años	3 meses	6 meses	O/N
Emisión	14-ene-16	14-abr-16	14-ene-16	14-ene-16	14-ene-16	14-ene-16	14-ene-16	14-ene-16
Vencimiento	14-abr-16	14-abr-16	15-ene-16	12-ene-17	12-ene-18	13-abr-16	13-jul-16	15-ene-16
Plazo en días	91	91	1	364	729	90	181	1
Hora cierre	09:45	10:00	10:45	11:00	12:00	13:00	13:15	14:00
Participantes	G-8	G-4	G-1	G-3	G-7	G-3	G-3	G-1
<b>Montos</b>								
Demandado	575,0	65,0	1 915,5	120,0	1 187,9	318,0	493,0	2 637,6
Aceptado	575,0	65,0	1 500,0	30,0	300,0	200,0	200,0	2 637,6
<b>Tasas (%)</b>								
Mínima	0,71	0,70	3,60	4,74	5,75	4,17	4,40	3,62
Máxima	0,75	0,70	3,75	4,74	5,91	4,24	4,42	3,75
Promedio	0,75	0,70	3,71	4,74	5,86	4,19	4,41	3,73
<b>Precio (%)</b>								
Mínimo		99,8238		95,4255		98,9675	97,8489	
Máximo		99,8238		95,4263		98,9838	97,8593	
Promedio		99,8238		95,4258		98,9781	97,8530	

## III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US)

Operación	Monto	TC promedio
Compra/Venta	Sin movimiento	

## 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 efectuada a fuera de subasta son las publicadas en la Nota Informativa « Programa Monetario de Diciembre de 2015 ». La tasa de interés para las operaciones de compra directa temporal de títulos valores y de créditos de regulación monetaria para aquellas entidades que hayan utilizado estas facilidades en más de 15 veces en los últimos 12 meses es de 5,30 por ciento anual.

En la compra directa temporal de títulos valores se aceptarán los indicados en la Circular N° 033-2015-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/.)	129,5	2,50
Extranjera (US\$)	1 842,4	0,3529

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

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	4 137,6	<a href="#">Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)</a>
Depósito a plazo Tesoro Público	Coloc-TP	3 050,0	<a href="#">Circular 021-2015-BCRP (08/05/2015)</a>
Depósito a plazo Banco de la Nación	Coloc-BN	600,0	<a href="#">Circular 021-2015-BCRP (08/05/2015)</a>
Certificado de Depósito	CD	14 710,0	<a href="#">Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)</a>
Certificado de Depósito Reajutable	CDR	7 961,5	<a href="#">Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)</a>
Certificado de Depósito Tasa Variable	CDV	160,0	<a href="#">Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)</a>
Certificado de Depósito Liquidable en US\$	COLD	0,0	<a href="#">Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)</a>
<b>TOTAL</b>		<b>30 619,1</b>	

## VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE NUEVOS SOLES

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Valore	REP	300,0	<a href="#">Circular 051-2013-BCRP (27/12/2013)</a>
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E.	SWAP	14 900,0	<a href="#">Circular 017-2014-BCRP (07/05/2014)</a>
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E. Expansión	REPO-MDA-EX	7 900,0	<a href="#">Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)</a>
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E. Sustitución	REPO-MDA-SUST	4 804,7	<a href="#">Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)</a>
REPO Especial para Colocación de CDR	REPO-CDR	1 900,0	<a href="#">Circular 033-2015-BCRP (26/08/2015)</a>
<b>TOTAL</b>		<b>29 804,7</b>	

## VIII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE USD

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Repo para provisión de USD	RED	0,0	<a href="#">Circular 050-2013-BCRP (27/12/2013)</a>

## IX. SWAP CAMBIARIO (En Nuevos Soles)

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
SWAP CAMBIARIO Compra	SC-Compra	0,0	<a href="#">Circular 031-2014-BCRP (15/09/2014)</a>
SWAP CAMBIARIO Venta	SC-Venta	28 001,9	<a href="#">Circular 031-2014-BCRP (15/09/2014)</a>

## X. 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 051-2013-BCRP y 045-2008-BCRP.
- 7/ El Grupo 7 (G-7) incluye a las entidades autorizadas mediante Circular 017-2014-BCRP.
- 8/ El Grupo 8 (G-8) incluye a las empresas de operaciones múltiples autorizadas a captar depósitos del público, según Art. 16 Ley 26702 y el Banco Agropecuario.
- 9/ El Grupo 9 (G-9) incluye a las entidades autorizadas mediante Circulares 021-2015-BCRP.
- 10/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.