



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 01 de octubre de 2014

Cifras en millones y tasas en porcentajes

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	REPO-2071	CD-4137	REPO-2072	CDR-289	REPO-2073	SWAP-98	REPO-2074
Monto Subasta	1 000,0	100,0	2 500,0	300,0	1 000,0	300,0	300,0
Plazo	O/N	18 meses	O/N	2 meses	1 Semana	3 meses	3 meses
Emisión	01-oct-14	01-oct-14	01-oct-14	01-oct-14	01-oct-14	01-oct-14	01-oct-14
Vencimiento	02-oct-14	07-abr-16	02-oct-14	03-dic-14	09-oct-14	30-dic-14	30-dic-14
Plazo en días	1	554	1	63	8	90	90
Hora cierre	10:30	11:00	13:00	13:10	13:20	13:40	13:50
Participantes	G-1	G-3	G-1	G-4	G-1	G-1	G-1
Montos							
Demandado	3 305,0	111,0	3 815,0	170,0	1 840,0	141,5	335,0
Aceptado	1 000,0	100,0	2 500,0	170,0	1 000,0	91,5	15,0
Tasas (%)							
Mínima	4,14	3,65	3,99	0,10	3,79	3,55	3,52
Máxima	4,16	3,65	4,17	0,15	3,96	3,83	3,52
Promedio	4,15	3,65	4,01	0,14	3,81	3,65	3,52
Precio (%)							
Mínimo		94,6330		99,9738			
Máximo		94,6330		99,9825			
Promedio		94,6330		99,9759			

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 s fuera de subasta son las publicadas en la Nota Informativa del [Programa Monetario de Setiembre de 2014](#).

En la compra directa temporal de títulos valores se aceptarán los indicados en la [Circular N° 051-2013-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/.)	0,0	2,30
Extranjera (US\$)	0,0	0,1315

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

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	0,0	Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito	CD	17 664,8	Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)
Certificado de Depósito Reajutable	CDR	6 125,0	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		23 789,8	

VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE NUEVOS SOLES

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Val.	REP	6 465,0	Circular 051-2013-BCRP (27/12/2013)
REPO Compra con Compromiso Recompra Mon. Ext.	SWAP	4 491,5	Circular 024-2009-BCRP (02/10/2009)
TOTAL		10 956,5	

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 031-2012-BCRP y 045-2008-BCRP.
- 7/ El Grupo 7 (G-7) incluye a las entidades autorizadas mediante Circular 024-2009-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/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.