



# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

## Operaciones Monetarias y Cambiarias del 01 de diciembre de 2014

Cifras en millones y tasas en porcentajes

### I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 1 850

### II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	CDR-303	CD-4162	SCV-37	SWAP-101	REPO-2130
Monto Subasta	300,0	100,0	300,0	500,0	3 200,0
Plazo	2 meses	6 meses	2 meses	1 año	O/N
Emisión	01-dic-14	01-dic-14	01-dic-14	01-dic-14	01-dic-14
Vencimiento	02-feb-15	11-jun-15	02-feb-15	30-nov-15	02-dic-14
Plazo en días	63	192	63	364	1
Hora cierre	10:45	11:00	11:20	13:45	14:00
Participantes	G-4	G-3	G-8	G-8	G-1
<b>Montos</b>					
Demandado	240,0	222,5	1 300,0	1 521,0	4 625,0
Aceptado	240,0	100,0	600,1	500,0	3 200,0
<b>Tasas (%)</b>					
Mínima	0,02	3,42	0,00	4,21	3,57
Máxima	0,05	3,62	0,00	4,52	3,90
Promedio	0,04	3,53	0,00	4,31	3,73
<b>Precio (%)</b>					
Mínimo	99,9913	98,1213			
Máximo	99,9965	98,2225			
Promedio	99,9925	98,1649			

### III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

Operación	Monto	TC promedio
Venta	5,0	2,9314

### 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 Noviembre 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/.)	20,0	2,30
Extranjera (US\$)	13,5	0,1167

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

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	0,0	<a href="#">Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)</a>
Certificado de Depósito	CD	15 735,1	<a href="#">Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)</a>
Certificado de Depósito Reajutable	CDR	2 660,0	<a href="#">Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)</a>
Certificado de Depósito Tasa Variable	CDV	0,0	<a href="#">Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)</a>
Certificado de Depósito Liquidable en US\$	CDLD	0,0	<a href="#">Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)</a>
<b>TOTAL</b>		<b>18 395,1</b>	

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

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Val.	REP	3 815,0	<a href="#">Circular 051-2013-BCRP (27/12/2013)</a>
REPO Compra con Compromiso Recompra Mon. Ext.	SWAP	5 591,5	<a href="#">Circular 017-2014-BCRP (07/05/2014)</a>
<b>TOTAL</b>		<b>9 406,5</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	13 259,9	<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/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.