



Operaciones Monetarias y Cambiarias del 05 de diciembre de 2014

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 1 900

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	SCV-307	SCV-41	SCV-42	SWAP-102	REPO-2134	REPO-2135
Monto Subasta	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0	4 200,0
Plazo	3 meses	6 meses	6 meses	1 año	3 meses	0/N
Emisión	05-dic-14	05-dic-14	05-dic-14	05-dic-14	05-dic-14	05-dic-14
Vencimiento	05-mar-15	05-jun-15	05-jun-15	07-dic-15	05-mar-15	09-dic-14
Plazo en días	90	182	182	367	90	4
Hora cierre	11:30	11:30	13:00	13:30	13:45	14:00
Participantes	G-4	G-8	G-8	G-8	G-1	G-1
Montos						
Demandado	120,0	1 199,0	900,0	1 200,0	600,0	5 814,5
Aceptado	120,0	300,0	300,0	300,0	300,0	4 200,0
Tasas (%)						
Mínima	0,15	-0,02	-0,02	4,52	4,56	4,81
Máxima	0,15	-0,01	-0,02	4,52	4,70	5,25
Promedio	0,15	-0,01	-0,02	4,52	4,62	4,92
Precio (%)						
Mínimo	99,9625					
Máximo	99,9625					
Promedio	99,9625					

III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

Operación	Monto	TC promedio
Compra/Venta	155,0	2,9531

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/.)	470,0	2,30
Extranjera (US\$)	10,8	0,1190

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	15 935,1	Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)
Certificado de Depósito Reajutable	CDR	2 295,0	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		18 230,1	

VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE NUEVOS SOLES

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Val.	REP	5 115,0	Circular 051-2013-BCRP (27/12/2013)
REPO Compra con Compromiso Recompra Mon. Ext.	SWAP	5 291,5	Circular 017-2014-BCRP (07/05/2014)
TOTAL		10 406,5	

VIII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE USD

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Repo para provisión de USD	RED	0,0	Circular 050-2013-BCRP (27/12/2013)

IX. SWAP CAMBIARIO (En Nuevos Soles)

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
SWAP CAMBIARIO Compra	SC-Compra	0,0	Circular 031-2014-BCRP (15/09/2014)
SWAP CAMBIARIO Venta	SC-Venta	14 759,7	Circular 031-2014-BCRP (15/09/2014)

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.