



Operaciones Monetarias y Cambiarias del 31 de diciembre de 2014

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 2 800

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	CD-4173	SCV-62	SWAP-112	REPO-2151
	CD	SCV	SWAP	REPO
Monto Subasta	50,0	300,0	500,0	1 000,0
Plazo	18 meses	2 meses	18 meses	0/N
Emisión	31-dic-14	31-dic-14	31-dic-14	31-dic-14
Vencimiento	09-jun-16	03-mar-15	30-jun-16	05-ene-15
Plazo en días	526	62	547	5
Hora cierre	11:00	09:40	13:15	13:30
Participantes	G-3	G-8	G-8	G-1
Montos				
Demandado	125,0	465,0	1 175,0	1 040,0
Aceptado	25,0	300,0	500,0	1 000,0
Tasas (%)				
Mínima	3,49	0,01	3,70	3,98
Máxima	3,55	0,01	4,48	4,05
Promedio	3,52	0,01	4,22	3,98
Precio (%)				
Mínimo	95,0307			
Máximo	95,1112			
Promedio	95,0683			

III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

Operación	Monto	TC promedio
Venta	5,0	2,9806

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 Diciembre 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/.)	517,0	2,30
Extranjera (US\$)	1 064,8	0,1279

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	15 575,1	Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)
Certificado de Depósito Reajutable	CDR	2 590,0	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		18 165,1	

VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE NUEVOS SOLES

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Val.	REP	1 300,0	Circular 051-2013-BCRP (27/12/2013)
REPO Compra con Compromiso Recompra Mon. Ext.	SWAP	8 600,0	Circular 017-2014-BCRP (07/05/2014)
TOTAL		9 900,0	

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	16 472,9	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.