



Operaciones Monetarias y Cambiarias del 24 de diciembre de 2014

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 2 650

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento | CDR-BCRP | CDR | SCVP | SWAP | REPO |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | CD-4171 | CDR-311 | SCV-55 | SWAP-110 | REPO-2149 |
| Monto Subasta | 100,0 | 300,0 | 300,0 | 400,0 | 1 200,0 |
| Plazo | 18 meses | 2 meses | 2 meses | 1 año | O/N |
| Emisión | 24-dic-14 | 24-dic-14 | 24-dic-14 | 24-dic-14 | 24-dic-14 |
| Vencimiento | 09-jun-16 | 24-feb-15 | 24-feb-15 | 23-dic-15 | 26-dic-14 |
| Plazo en días | 533 | 62 | 62 | 364 | 2 |
| Hora cierre | 11:00 | 10:30 | 10:30 | 13:15 | 13:30 |
| Participantes | G-3 | G-4 | G-8 | G-8 | G-1 |
| Montos | | | | | |
| Demandado | 160,0 | 330,0 | 1 000,0 | 1 130,0 | 1 045,0 |
| Aceptado | 20,0 | 300,0 | 300,0 | 400,0 | 1 045,0 |
| Tasas (%) | | | | | |
| Mínima | 3,50 | 0,05 | -1,06 | 4,38 | 3,56 |
| Máxima | 3,55 | 0,05 | -1,06 | 4,38 | 4,01 |
| Promedio | 3,51 | 0,05 | -1,06 | 4,38 | 3,98 |
| Precio (%) | | | | | |
| Mínimo | 94,9663 | 99,9914 | | | |
| Máximo | 95,0342 | 99,9914 | | | |
| Promedio | 95,0172 | 99,9914 | | | |

III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

| Operación | Monto | TC promedio |
|-----------|-------|-------------|
| Venta | 2,0 | 2,9820 |

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/.) | 841,0 | 2,30 |
| Extranjera (US\$) | 1 943,6 | 0,1496 |

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 | 15 500,1 | Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012) |
| Certificado de Depósito Reajutable | CDR | 2 795,0 | 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 | | 18 295,1 | |

VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE NUEVOS SOLES

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|--|--------|-----------------|---|
| REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Val. | REP | 2 660,0 | Circular 051-2013-BCRP (27/12/2013) |
| REPO Compra con Compromiso Recompra Mon. Ext. | SWAP | 8 191,5 | Circular 017-2014-BCRP (07/05/2014) |
| TOTAL | | 10 851,5 | |

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 | 16 098,0 | 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.