



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 01 de junio de 2015

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 3 250

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	CD-BCRP	SCV	SWAP	REPO
	CD-4249	SCV-212	SWAP-141	REPO-2246
Monto Subasta	50,0	300,0	500,0	1 000,0
Plazo	6 meses	3 meses	6 meses	O/N
Emisión	01-jun-15	01-jun-15	01-jun-15	01-jun-15
Vencimiento	10-dic-15	01-sep-15	04-dic-15	02-jun-15
Plazo en días	192	92	186	1
Hora cierre	11:00	13:00	13:45	14:00
Participantes	G-3	G-8	G-8	G-1
Montos				
Demandado	279,0	300,0	1 185,0	1 050,0
Aceptado	50,0	200,0	500,0	1 000,0
Tasas (%)				
Mínima	3,14	0,17	3,71	3,67
Máxima	3,21	0,20	4,15	3,71
Promedio	3,16	0,18	3,94	3,69
Precio (%)				
Mínimo	98,3290			
Máximo	98,3646			
Promedio	98,3541			

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 Mayo de 2015](#).

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/.)	450,0	2,00
Extranjera (US\$)	467,2	0,1400

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

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo Banco Central de Reserva del Perú.	DP	0,0	Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)
Depósito a plazo Tesoro Público.	Coloc-TP	600,0	Circular 021-2015-BCRP (08/05/2015)
Depósito a plazo Banco de la Nación.	Coloc-BN	300,0	Circular 021-2015-BCRP (08/05/2015)
Certificado de Depósito	CD	14 029,5	Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)
Certificado de Depósito Reajutable	CDR	600,0	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		15 529,5	

VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE NUEVOS SOLES

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Valores	REP	2 760,0	Circular 051-2013-BCRP (27/12/2013)
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E.	SWAP	11 500,0	Circular 017-2014-BCRP (07/05/2014)
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E. Expansión	REPO-MDA-EXPANSIÓN	4 500,0	Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E. Sustitución	REPO-MDA-SUSTITUCIÓN	3 473,0	Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)
TOTAL		22 233,0	

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	24 613,0	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/ El Grupo 9 (G-9) incluye a las entidades autorizadas mediante Circulares 021-2015-BCRP.
- 10/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.