

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 03 de febrero de 2016
Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 3 300

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	SCV-535	DP-1131	CD-4434	CDR-426	SCV-536	DP-1132
Monto Subasta	220,0	350,0	30,0	300,0	300,0	400,0
Plazo	3 meses	O/N	18 meses	2 meses	6 meses	O/N
Emisión	03-feb-16	03-feb-16	03-feb-16	03-feb-16	03-feb-16	03-feb-16
Vencimiento	04-may-16	04-feb-16	10-ago-17	04-abr-16	03-ago-16	04-feb-16
Plazo en días	91	1	554	61	182	1
Hora cierre	09:45	10:45	11:00	11:10	11:30	14:00
Participantes	G-8	G-1	G-3	G-4	G-8	G-1
Montos						
Demandado	170,0	758,0	15,2		110,0	649,0
Aceptado	170,0	350,1	0,2	Desierta	110,0	400,0
Tasas (%)						
Mínima	0,74	3,88	4,05		0,74	3,88
Máxima	0,74	3,97	4,10		0,74	3,96
Promedio	0,74	3,96	4,07		0,74	3,93
Precio (%)						
Mínimo			94,0038			
Máximo			94,0733			
Promedio			94,0386			

III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

Operación	Monto	TC promedio
Venta	5,0	3,4926

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

efectuadas fuera de subasta son las publicadas en la Nota Informativa del [Programa Monetario de Enero de 2016](#).

La tasa de interés para las operaciones de compra directa temporal de títulos valores y de créditos de regulación monetaria para aquellas entidades que hayan utilizado estas facilidades en más de 15 veces en los últimos 12 meses es de 5,30 por ciento anual.

En la compra directa temporal de títulos valores se aceptarán los indicados en la **Circular N° 033-2015-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/.)	0,0	2,75
Extranjera (US\$)	60,0	0,3680

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

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	750,1	Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)
Depósito a plazo Tesoro Público	Coloc-TP	3 050,0	Circular 021-2015-BCRP (08/05/2015)
Depósito a plazo Banco de la Nación	Coloc-BN	600,0	Circular 021-2015-BCRP (08/05/2015)
Certificado de Depósito	CD	15 831,4	Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)
Certificado de Depósito Reajutable	CDR	7 935,2	Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)
Certificado de Depósito Tasa Variable	CDV	160,0	Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito Liquidable en US\$	CDLD	0,0	Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)
TOTAL		28 326,7	

VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE NUEVOS SOLES

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Valores	REP	300,0	Circular 051-2013-BCRP (27/12/2013)
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E.	SWAP	14 400,0	Circular 017-2014-BCRP (07/05/2014)
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E. Expansión	REPO-MDA-EX	7 900,0	Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E. Sustitución	REPO-MDA-SUST	4 804,7	Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)
REPO Especial para Colocación de CDR	REPO-CDR	1 600,0	Circular 033-2015-BCRP (26/08/2015)
TOTAL		29 004,7	

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	31 286,7	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/ 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.