

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 18 de febrero de 2016
Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 2 350

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	SCV-557	CD-4457	DP-1153	CD-4458	CD-4459	CDR-441	CD-4460	SCV-558	DP-1154
Monto Subasta	450,0	300,0	1 000,0	30,0	150,0	300,0	150,0	250,0	1 000,0
Plazo	3 meses	3 meses	O/N	1 año	6 meses	3 meses	1 año	3 meses	O/N
Emisión	18-feb-16	18-feb-16	18-feb-16	18-feb-16	18-feb-16	18-feb-16	18-feb-16	18-feb-16	18-feb-16
Vencimiento	18-may-16	10-may-16	19-feb-16	09-feb-17	11-ago-16	18-may-16	09-feb-17	18-may-16	19-feb-16
Plazo en días	90	82	1	357	175	90	357	90	1
Hora cierre	09:45	10:30	10:45	11:00	13:10	13:10	13:20	13:20	14:00
Participantes	G-8	G-3	G-1	G-3	G-3	G-4	G-3	G-8	G-1
Montos									
Demandado	900,0	44,0	1 840,7	135,0		250,0	148,0	634,0	1 272,8
Aceptado	295,0	39,0	1 000,0	30,0	Desierta	150,0	148,0	250,0	1 000,0
Tasas (%)									
Mínima	0,75	4,55	4,19	5,05		0,70	5,05	0,69	4,15
Máxima	0,75	4,60	4,23	5,05		0,75	5,30	0,74	4,23
Promedio	0,75	4,57	4,20	5,05		0,72	5,11	0,72	4,21
Precio (%)									
Mínimo		98,9808		95,2319		99,8134	95,0076		
Máximo		98,9916		95,2319		99,8260	95,2319		
Promedio		98,9866		95,2319		99,8210	95,1743		

III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

Operación	Monto	TC promedio
Venta	13,0	3,5066

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 Febrero 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 5,80 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/.)	36,4	3,00
Extranjera (US\$)	871,5	0,3803

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

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	2 000,0	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	17 092,3	Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)
Certificado de Depósito Reajutable	CDR	8 510,6	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		31 412,9	

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	14 000,0	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		28 604,7	

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	30 946,7	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.