

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 14 de septiembre de 2016
Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/ 3 450

II. SUBASTAS (En Soles)

| Instrumento | CD-4648 | DP-1278 | CD-4649 | DP-1279 |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Monto Subasta | 50,0 | 800,0 | 100,0 | 1 000,0 |
| Plazo | 18 meses | O/N | 6 meses | O/N |
| Emisión | 14-sep-16 | 14-sep-16 | 14-sep-16 | 14-sep-16 |
| Vencimiento | 08-mar-18 | 15-sep-16 | 09-mar-17 | 15-sep-16 |
| Plazo en días | 540 | 1 | 176 | 1 |
| Hora cierre | 11:00 | 11:00 | 13:40 | 14:00 |
| Participantes | G-3 | G-1 | G-3 | G-1 |
| Montos | | | | |
| Demandado | 217,0 | 888,0 | 321,4 | 1 416,6 |
| Aceptado | 50,0 | 800,1 | 100,0 | 1 000,0 |
| Tasas (%) | | | | |
| Mínima | 4,94 | 4,05 | 4,49 | 4,14 |
| Máxima | 4,99 | 4,25 | 4,50 | 4,19 |
| Promedio | 4,96 | 4,24 | 4,49 | 4,15 |
| Precio (%) | | | | |
| Mínimo | 92,9561 | | 97,8712 | |
| Máximo | 93,0226 | | 97,8757 | |
| Promedio | 92,9896 | | 97,8712 | |

III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

| Operación | Monto | TC promedio |
|----------------|----------------|-------------|
| Compra / Venta | Sin movimiento | |

IV. OPERACIONES DE VENTANILLA

| Operación | Monto | Tasa |
|--------------|----------------|------|
| Repo Directo | 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 Setiembre 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/) | 151,4 | 3,00 |
| Extranjera (US\$) | 1 378,5 | 0,4244 |

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

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|--|----------|-----------------|---|
| Depósito a plazo | DP | 2 061,3 | Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Depósito a plazo Tesoro Público | Coloc-TP | 1 300,0 | Circular 021-2015-BCRP (08/05/2015) |
| Depósito a plazo Banco de la Nación | Coloc-BN | 0,0 | Circular 021-2015-BCRP (08/05/2015) |
| Certificado de Depósito | CD | 26 677,9 | Circular 016-2016-BCRP (04/05/2012) |
| Certificado de Depósito Reajutable | CDR | 600,0 | Circular 016-2016-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 | | 30 639,2 | |

VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE SOLES

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|--|---------------|-----------------|---|
| REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Valores | REP | 800,0 | Circular 051-2013-BCRP (27/12/2013) |
| REPO Compra con Compromiso Recompra M.E. | SWAP | 15 200,1 | Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015) |
| 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 | 0,0 | Circular 033-2015-BCRP (26/08/2015) |
| TOTAL | | 28 704,8 | |

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 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 | 1 846,6 | Circular 031-2014-BCRP (15/09/2014) |

X. INFORMES

Departamento de Operaciones Monetarias y Cambiarias

Teléfonos 613-2000 Anexos: 24521, 24561, 24527
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 016-2016-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.