

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.