



# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

## Operaciones Monetarias y Cambiarias del 15 de septiembre de 2011

Cifras en millones y tasas en porcentajes

### I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 6 950

### II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento       | CD-3291   | CD-3292   | DP-373    |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|
| Monto Subasta     | 60,0      | 200,0     | 1 600,0   |
| Plazo             | 1 Año     | 3 Meses   | Overnight |
| Emisión           | 15-sep-11 | 15-sep-11 | 15-sep-11 |
| Vencimiento       | 13-sep-12 | 13-dic-11 | 16-sep-11 |
| Plazo en días     | 364       | 89        | 1         |
| Hora cierre       | 12:00     | 13:15     | 14:00     |
| Participantes     | G-3       | G-3       | G-1       |
| <b>Montos</b>     |           |           |           |
| Demandado         | 274,0     | 540,4     | 1 229,8   |
| Aceptado          | 60,0      | 199,9     | 1 229,8   |
| <b>Tasas (%)</b>  |           |           |           |
| Mínima            | 4,19      | 4,17      | 4,18      |
| Máxima            | 4,20      | 4,25      | 4,25      |
| Promedio          | 4,19      | 4,23      | 4,23      |
| <b>Precio (%)</b> |           |           |           |
| Mínimo            | 95,9264   | 98,9763   |           |
| Máximo            | 95,9361   | 98,9951   |           |
| Promedio          | 95,9313   | 98,9806   |           |

### III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

| Operación    | Monto      | TC promedio |
|--------------|------------|-------------|
| Compra/venta | Sin movim. |             |

### IV. OPERACIONES DE VENTANILLA

| Operación | Monto      | Tasa |
|-----------|------------|------|
|           | Sin movim. |      |

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 2011](#).

En la compra directa temporal de títulos valores se aceptarán los indicados en el numeral 1 de la Circular N° 015-2006-BCRP. 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   | 3,45   |
| Extranjera (US\$) | 0,0   | 0,0857 |

### VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

| Instrumentos                               | Código | Saldo           | Circular Vigente                                    |
|--|--------|-----------------|---|
| Depósito a plazo                           | DP     | 1 229,8         | <a href="#">Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)</a> |
| Certificado de Depósito                    | CD     | 8 380,3         | <a href="#">Circular 034-2008-BCRP (15/08/2008)</a> |
| Certificado de Depósito Reajutable         | CDR    | 0,0             | <a href="#">Circular 034-2008-BCRP (15/08/2008)</a> |
| Certificado de Depósito Tasa Variable      | CDV    | 8 309,9         | <a href="#">Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)</a> |
| Certificado de Depósito Liquidable en US\$ | CDLD   | 0,0             | <a href="#">Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)</a> |
| <b>TOTAL</b>                               |        | <b>17 920,0</b> |   |

### VII. 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 034-2008-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 034-2008-BCRP y 015-2006-BCRP.
- 7/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.