



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 18 de septiembre de 2012

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 14 000

El monto considera las subastas realizadas antes del mediodía.

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento | DP-575 | CD-3579 | CD-3580 | DP-576 |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Monto Subasta | 4 000,0 | 50,0 | 150,0 | 5 600,0 |
| Plazo | Overnight | 6 Meses | 1 Año | Overnight |
| Emisión | 18-sep-12 | 18-sep-12 | 18-sep-12 | 18-sep-12 |
| Vencimiento | 19-sep-12 | 12-mar-13 | 12-sep-13 | 19-sep-12 |
| Plazo en días | 1 | 175 | 359 | 1 |
| Hora cierre | 10:30 | 12:00 | 13:10 | 14:00 |
| Participantes | G-1 | G-3 | G-3 | G-1 |
| Montos | | | | |
| Demandado | 9 201,4 | 408,6 | 777,3 | 7 713,0 |
| Aceptado | 4 000,3 | 50,0 | 150,1 | 5 599,7 |
| Tasas (%) | | | | |
| Mínima | 4,22 | 3,94 | 3,95 | 4,19 |
| Máxima | 4,23 | 3,94 | 4,00 | 4,23 |
| Promedio | 4,23 | 3,94 | 3,97 | 4,22 |
| Precio (%) | | | | |
| Mínimo | | 98,1390 | 96,1644 | |
| Máximo | | 98,1390 | 96,2095 | |
| Promedio | | 98,1390 | 96,1894 | |

III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

| Operación | Monto | TC promedio |
|-----------|-------|-------------|
| Compra | 40,0 | 2,6026 |

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 Septiembre de 2012](#).

En la compra directa temporal de títulos valores se aceptarán los indicados en la **Circular N° 016-2012-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 | 3,45 |
| Extranjera (US\$) | 3,9 | 0,1795 |

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

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|--|--------|-----------------|---|
| Depósito a plazo | DP | 9 600,0 | Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Certificado de Depósito | CD | 17 689,6 | Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012) |
| Certificado de Depósito Reajutable | CDR | 0,0 | Circular 013-2012-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 | | 27 289,6 | |

VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE NUEVOS SOLES

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|-------------------------------------|--------|-------|---|
| Repo para provisión de Nuevos Soles | REP | 0,0 | Circular 016-2012-BCRP (20/06/2012) |

VIII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE USD

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|----------------------------|--------|-------|---|
| Repo para provisión de USD | RED | 0,0 | Circular 012-2011-BCRP (28/04/2011) |

IX. 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 015-2006-BCRP y 045-2008-BCRP.
- 7/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.