



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 02 de octubre de 2014

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 4 650

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento | REPO-2075 | CD-4138 | CDR-290 | REPO-2076 | REPO-2077 |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Monto Subasta | 2 000,0 | 100,0 | 300,0 | 1 000,0 | 2 000,0 |
| Plazo | O/N | 1 año | 2 meses | 1 Semana | O/N |
| Emisión | 02-oct-14 | 02-oct-14 | 02-oct-14 | 02-oct-14 | 02-oct-14 |
| Vencimiento | 03-oct-14 | 15-oct-15 | 04-dic-14 | 09-oct-14 | 03-oct-14 |
| Plazo en días | 1 | 378 | 63 | 7 | 1 |
| Hora cierre | 10:30 | 11:00 | 12:10 | 13:45 | 14:00 |
| Participantes | G-1 | G-3 | G-4 | G-1 | G-1 |
| Montos | | | | | |
| Demandado | 4 105,0 | 166,0 | 155,0 | 1 680,0 | 2 146,0 |
| Aceptado | 2 000,0 | 100,0 | 155,0 | 1 000,0 | 2 000,0 |
| Tasas (%) | | | | | |
| Mínima | 3,81 | 3,50 | 0,14 | 3,81 | 3,51 |
| Máxima | 4,06 | 3,86 | 0,15 | 3,81 | 4,18 |
| Promedio | 3,85 | 3,73 | 0,15 | 3,81 | 3,73 |
| Precio (%) | | | | | |
| Mínimo | | 96,1000 | 99,9738 | | |
| Máximo | | 96,4523 | 99,9755 | | |
| Promedio | | 96,2277 | 99,9740 | | |

III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

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

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 Setiembre de 2014](#).

En la compra directa temporal de títulos valores se aceptarán los indicados en la [Circular N° 051-2013-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 | 2,30 |
| Extranjera (US\$) | 0,0 | 0,1362 |

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

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|--|--------|-----------------|---|
| Depósito a plazo | DP | 0,0 | Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Certificado de Depósito | CD | 17 764,8 | Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012) |
| Certificado de Depósito Reajutable | CDR | 6 280,0 | 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 | | 24 044,8 | |

VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE NUEVOS SOLES

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|--|--------|-----------------|---|
| REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Val. | REP | 9 265,0 | Circular 051-2013-BCRP (27/12/2013) |
| REPO Compra con Compromiso Recompra Mon. Ext. | SWAP | 4 791,5 | Circular 024-2009-BCRP (02/10/2009) |
| TOTAL | | 14 056,5 | |

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 031-2012-BCRP y 045-2008-BCRP.
- 7/ El Grupo 7 (G-7) incluye a las entidades autorizadas mediante Circular 024-2009-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/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.