



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 03 de octubre de 2014

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 6 100

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	CDR-291	SC-Venta-001	REPO-2078	REPO-2079
Monto Subasta	300,0	300,0	2 000,0	1 500,0
Plazo	2 meses	2 meses	O/N	O/N
Emisión	03-oct-14	03-oct-14	03-oct-14	03-oct-14
Vencimiento	05-dic-14	05-dic-14	06-oct-14	06-oct-14
Plazo en días	63	63	3	3
Hora cierre	09:40	09:40	10:30	14:00
Participantes	G-4	G-8	G-1	G-1
Montos				
Demandado	140,0	570,0	3 550,0	2 270,0
Aceptado	140,0	300,0	2 000,0	1 500,0
Tasas (%)				
Mínima	0,15	0,00	3,54	3,52
Máxima	0,15	0,15	3,91	3,98
Promedio	0,15	0,10	3,60	3,58
Precio (%)				
Mínimo	99,9738			
Máximo	99,9739			
Promedio	99,9738			

III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

Operación	Monto	TC promedio
Venta	40,0	2,9016

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/.)	410,0	2,30
Extranjera (US\$)	6,0	0,1452

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	6 420,0	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		24 184,8	

VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE NUEVOS SOLES

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Val.	REP	8 765,0	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		13 556,5	

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. SWAP CAMBIARIO (En Nuevos 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	300,0	Circular 031-2014-BCRP (15/09/2014)

X. 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.