



## Operaciones Monetarias y Cambiarias del 04 de diciembre de 2014

Cifras en millones y tasas en porcentajes

## I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 2 200

## II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento       | CDR-BCRP  | CDR       | REPO      | REPO-2133 |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
|                   | CD-4164   | CDR-306   | SCV-40    | REPO-2133 |
| Monto Subasta     | 100,0     | 300,0     | 300,0     | 3 300,0   |
| Plazo             | 1 año     | 3 meses   | 3 meses   | 0/N       |
| Emisión           | 04-dic-14 | 04-dic-14 | 04-dic-14 | 04-dic-14 |
| Vencimiento       | 10-dic-15 | 04-mar-15 | 04-mar-15 | 05-dic-14 |
| Plazo en días     | 371       | 90        | 90        | 1         |
| Hora cierre       | 11:00     | 10:45     | 10:45     | 14:00     |
| Participantes     | G-3       | G-4       | G-8       | G-1       |
| <b>Montos</b>     |           |           |           |           |
| Demandado         | 264,5     | 60,0      | 1 305,0   | 6 977,0   |
| Aceptado          | 100,0     | 60,0      | 300,0     | 3 300,0   |
| <b>Tasas (%)</b>  |           |           |           |           |
| Mínima            | 3,40      | 0,10      | -0,01     | 4,28      |
| Máxima            | 3,46      | 0,10      | 0,00      | 4,30      |
| Promedio          | 3,45      | 0,10      | 0,00      | 4,29      |
| <b>Precio (%)</b> |           |           |           |           |
| Mínimo            | 96,5553   | 99,9751   |           |           |
| Máximo            | 96,6130   | 99,9751   |           |           |
| Promedio          | 96,5611   | 99,9751   |           |           |

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

| Operación | Monto | TC promedio |
|-----------|-------|-------------|
| Venta     | 15    | 2,9478      |

## 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 Noviembre 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/.)    | 466,3 | 2,30   |
| Extranjera (US\$) | 14,5  | 0,1163 |

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

| Instrumentos                               | Código | Saldo           | Circular Vigente                                    |
|--|--------|-----------------|---|
| Depósito a plazo                           | DP     | 0,0             | <a href="#">Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)</a> |
| Certificado de Depósito                    | CD     | 15 935,1        | <a href="#">Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)</a> |
| Certificado de Depósito Reajutable         | CDR    | 2 315,0         | <a href="#">Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)</a> |
| Certificado de Depósito Tasa Variable      | CDV    | 0,0             | <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>18 250,1</b> |   |

## VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE NUEVOS SOLES

| Instrumentos                                     | Código | Saldo          | Circular Vigente                                    |
|--|--------|----------------|---|
| REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Val. | REP    | 3 915,0        | <a href="#">Circular 051-2013-BCRP (27/12/2013)</a> |
| REPO Compra con Compromiso Recompra Mon. Ext.    | SWAP   | 5 291,5        | <a href="#">Circular 017-2014-BCRP (07/05/2014)</a> |
| <b>TOTAL</b>                                     |        | <b>9 206,5</b> |   |

## VIII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE USD

| Instrumentos               | Código | Saldo | Circular Vigente                                    |
|----------------------------|--------|-------|---|
| Repo para provisión de USD | RED    | 0,0   | <a href="#">Circular 050-2013-BCRP (27/12/2013)</a> |

## IX. SWAP CAMBIARIO (En Nuevos Soles)

| Instrumentos          | Código    | Saldo    | Circular Vigente                                    |
|-----------------------|-----------|----------|---|
| SWAP CAMBIARIO Compra | SC-Compra | 0,0      | <a href="#">Circular 031-2014-BCRP (15/09/2014)</a> |
| SWAP CAMBIARIO Venta  | SC-Venta  | 14 459,7 | <a href="#">Circular 031-2014-BCRP (15/09/2014)</a> |

## 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 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/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.