



# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

## Operaciones Monetarias y Cambiarias del 22 de abril de 2015

Cifras en millones y tasas en porcentajes

### I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 1 200

### II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento       | CD-4232   | SCV-161   | SCV-162   | SCV-163   | REPO-SUSTITUCIÓN-130 | REPO-2224 | DP-941    |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|----------------------|-----------|-----------|
| Monto Subasta     | 50,0      | 600,0     | 600,0     | 600,0     | 400,0                | 1 300,0   | 300,0     |
| Plazo             | 18 meses  | 2 meses   | 2 meses   | 2 meses   | 3 años               | O/N       | O/N       |
| Emisión           | 22-abr-15 | 22-abr-15 | 22-abr-15 | 22-abr-15 | 22-abr-15            | 22-abr-15 | 22-abr-15 |
| Vencimiento       | 06-oct-16 | 30-jun-15 | 01-jul-15 | 02-jul-15 | 20-abr-18            | 23-abr-15 | 23-abr-15 |
| Plazo en días     | 533       | 69        | 70        | 71        | 1094                 | 1         | 1         |
| Hora cierre       | 11:00     | 10:25     | 11:30     | 13:00     | 13:10                | 13:30     | 13:30     |
| Participantes     | G-3       | G-8       | G-8       | G-8       | G-8                  | G-1       | G-8       |
| <b>Montos</b>     |           |           |           |           |                      |           |           |
| Demandado         | 87,0      | 1 445,0   | 1 620,0   |           | 150,0                | 2 343,0   | 424,5     |
| Aceptado          | 50,0      | 600,0     | 600,0     | Desierta  | 150,0                | 1 300,0   | 300,0     |
| <b>Tasas (%)</b>  |           |           |           |           |                      |           |           |
| Mínima            | 3,33      | -0,61     | -0,51     |           | 3,25                 | 3,87      | 2,75      |
| Máxima            | 3,39      | -0,46     | -0,20     |           | 3,25                 | 3,96      | 3,00      |
| Promedio          | 3,35      | -0,54     | -0,39     |           | 3,25                 | 3,92      | 2,96      |
| <b>Precio (%)</b> |           |           |           |           |                      |           |           |
| Mínimo            | 95,1840   |           |           |           |                      |           |           |
| Máximo            | 95,2658   |           |           |           |                      |           |           |
| Promedio          | 95,2332   |           |           |           |                      |           |           |

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

| Operación | Monto | TC promedio |
|-----------|-------|-------------|
| Venta     | 74,0  | 3,1305      |

### 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 Abril de 2015](#).

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/.)    | 988,8   | 2,05   |
| Extranjera (US\$) | 3 334,3 | 0,1262 |

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

| Instrumentos                               | Código | Saldo           | Circular Vigente                                    |
|--|--------|-----------------|---|
| Depósito a plazo                           | DP     | 300,0           | <a href="#">Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)</a> |
| Certificado de Depósito                    | CD     | 15 483,2        | <a href="#">Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)</a> |
| Certificado de Depósito Reajutable         | CDR    | 300,0           | <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>16 083,2</b> |   |

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

| Instrumentos   | Código               | Saldo           | Circular Vigente                                    |
|--|----------------------|-----------------|---|
| REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Valores  | REP                  | 3 200,0         | <a href="#">Circular 051-2013-BCRP (27/12/2013)</a> |
| REPO Compra con Compromiso Recompra M.E.             | SWAP                 | 9 200,0         | <a href="#">Circular 017-2014-BCRP (07/05/2014)</a> |
| REPO Compra con Compromiso Recompra M.E. Expansión   | REPO-MDA-EXPANSIÓN   | 3 300,0         | <a href="#">Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)</a> |
| REPO Compra con Compromiso Recompra M.E. Sustitución | REPO-MDA-SUSTITUCIÓN | 2 150,0         | <a href="#">Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)</a> |
| <b>TOTAL</b>   |                      | <b>17 850,0</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  | 25 880,1 | <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.