



### Operaciones Monetarias y Cambiarias del 26 de octubre de 2015

Cifras en millones y tasas en porcentajes

#### I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 2 600

#### II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	SCV-377	DP-1034	CD-4349	CDR-371	SCV	CDR-BCRP	DP-1035
Monto Subasta	300,0	1 000,0	50,0	300,0	300,0	300,0	1 700,0
Plazo	3 meses	O/N	6 meses	3 meses	3 meses	3 meses	O/N
Emisión	26-oct-15						
Vencimiento	27-ene-16	27-oct-15	07-abr-16	27-ene-16	27-ene-16	28-ene-16	27-oct-15
Plazo en días	93	1	164	93	93	94	1
Hora cierre	09:40	10:45	11:00	11:15	13:00	13:25	14:00
Participantes	G-8	G-1	G-3	G-4	G-8	G-4	G-1
<b>Montos</b>							
Demandado	332,0	701,0	246,9	400,0	226,4	300,0	1 539,0
Aceptado	300,0	701,0	50,0	300,0	76,4	300,0	1 539,0
Tasas (%)							
Minima	0,75	3,49	4,14	0,50	0,64	0,70	3,45
Maxima	0,75	3,50	4,18	0,75	0,75	0,75	3,50
Promedio	0,75	3,50	4,17	0,65	0,66	0,72	3,49
Precio (%)							
Minimo			98,1500	99,8072		99,8051	
Máximo			98,1690	99,8712		99,8181	
Promedio			98,1549	99,8328		99,8116	

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

Operación	Monto	TC promedio
Compras / Ventas	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 Octubre de 2015](#). La tasa de interés para las operaciones de compra directa temporal de títulos valores y de créditos de regulación monetaria para aquellas entidades que hayan utilizado estas facilidades en más de 15 veces en los últimos 12 meses es de 4,05 por ciento anual.

En la compra directa temporal de títulos valores se aceptarán los indicados en la Circular N° 033-2015-BCRP.

Las solicitudes deberán ser enviadas al Departamento de Operaciones Monetarias y Cambiarias vía fax/faximil 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/.)	369,3	2,25
Extranjera (US\$)	1 500,8	0,1300

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

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	2 720,0	<a href="#">Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)</a>
Depósito a plazo Tesoro Público	Coloc-TP	3 049,9	<a href="#">Circular 021-2015-BCRP (08/05/2015)</a>
Depósito a plazo Banco de la Nación	Coloc-BN	600,0	<a href="#">Circular 021-2015-BCRP (08/05/2015)</a>
Certificado de Depósito	CD	17 718,0	<a href="#">Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)</a>
Certificado de Depósito Reajustable	CDR	6 983,6	<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>		31 071,5	

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

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Valores	REP	450,0	<a href="#">Circular 033-2015-BCRP (26/08/2015)</a>
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E.	SWAP	15 950,0	<a href="#">Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)</a>
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E. Expansión	REPO-MDA-EX	7 900,0	<a href="#">Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)</a>
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E. Sustitución	REPO-MDA-SUST	4 804,7	<a href="#">Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)</a>
REPO Especial para Colocación de CDR	REPO-CDR	2 284,0	<a href="#">Circular 033-2015-BCRP (26/08/2015)</a>
<b>TOTAL</b>		31 388,7	

#### 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	22 662,8	<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, y 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/ El Grupo 9 (G-9) incluye a las entidades autorizadas mediante Circulares 021-2015-BCRP.