



Operaciones Monetarias y Cambiarias del 27 de octubre de 2015

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 2 900

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	SCV-379	DP-1036	SCV-380	SCV-381	REPOCDR-2312	DP-1037
Monto Subasta	600,0	1 000,0	300,0	300,0	300,0	1 600,0
Plazo	3 meses	O/N	2 meses	2 meses	3 meses	O/N
Emisión	27-oct-15	27-oct-15	27-oct-15	27-oct-15	27-oct-15	27-oct-15
Vencimiento	28-ene-16	28-oct-15	28-dic-15	30-dic-15	28-ene-16	28-oct-15
Plazo en días	93	1	62	64	93	1
Hora cierre	10:15	10:45	11:00	12:55	13:25	14:00
Participantes	G-8	G-1	G-8	G-8	G-4	G-1
Montos						
Demandado	100,0	1 299,5	588,0	540,0	600,0	1 861,2
Aceptado	100,0	1 000,0	300,0	300,0	300,0	1 600,0
Tasas (%)						
Minima	0,74	3,49	0,69	0,25	4,70	3,40
Maxima	0,74	3,50	0,69	0,65	4,70	3,50
Promedio	0,74	3,49	0,69	0,46	4,70	3,47
Precio (%)						
Minimo						
Máximo						
Promedio						

III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

Operación	Monto	TC promedio
Compras / Ventas	5,00	3.2792

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 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/.)	828,5	2,25
Extranjera (US\$)	2 625,6	0,1313

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

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	2 700,0	Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)
Depósito a plazo Tesoro Público	Coloc-TP	3 049,9	Circular 021-2015-BCRP (08/06/2015)
Depósito a plazo Banco de la Nación	Coloc-BN	600,0	Circular 021-2015-BCRP (08/05/2015)
Certificado de Depósito	CD	17 718,0	Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)
Certificado de Depósito Reajustable	CDR	7 283,6	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		31 351,5	

VII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE NUEVOS SOLES

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Valores	REP	450,0	Circular 033-2015-BCRP (26/08/2015)
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E.	SWAP	15 950,0	Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E. Expansión	REPO-MDA-EX	7 900,0	Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E. Sustitución	REPO-MDA-SUST	4 804,7	Circular 002-2015-BCRP (06/01/2015)
REPO Especial para Colocación de CDR	REPO-CDR	2 584,0	Circular 033-2015-BCRP (26/08/2015)
TOTAL		31 688,7	

VIII. SALDO DE REPO PARA PROVISIÓN DE USD

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Repo para provisión de USD	RED	0,0	Circular 050-2013-BCRP (27/12/2013)

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	22 746,3	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 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.