

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 18 de enero de 2016  
Cifras en millones y tasas en porcentajes

## I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 3 700

## II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	DP-1110	CD-4419	CD-4420	CD-4421	DP-1111
Monto Subasta	1 500,0	30,0	200,0	200,0	1 800,0
Plazo	O/N	6 meses	3 meses	1 año	O/N
Emisión	18-ene-16	18-ene-16	18-ene-16	18-ene-16	18-ene-16
Vencimiento	19-ene-16	14-Jul-16	13-abr-16	12-ene-17	19-ene-16
Plazo en días	1	178	86	360	1
Hora cierre	10:45	11:00	13:00	13:15	14:00
Participantes	G-1	G-3	G-3	G-3	G-1
<b>Montos</b>					
Demandado	1 451,6	185,0	468,0	517,0	2 204,7
Aceptado	1 451,6	30,0	94,0	200,0	1 799,9
<b>Tasas (%)</b>					
Mínima	3,85	4,45	4,23	4,80	3,88
Máxima	4,00	4,50	4,25	4,89	4,00
Promedio	3,99	4,47	4,23	4,84	3,95
<b>Precio (%)</b>					
Mínimo		97,8471	99,0106	95,3380	
Máximo		97,8703	99,0152	95,4198	
Promedio		97,8596	99,0142	95,3851	

## III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US)

Operación	Monto	TC promedio
Venta	4,0	3,4340

## 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 a fuera de subasta son las publicadas en la Nota Informativa « Programa Monetario de Enero de 2016 ». 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 5,30 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 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/.)	485,1	2,75
Extranjera (US\$)	1 015,5	0,3548

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

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	3 251,5	<a href="#">Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)</a>
Depósito a plazo Tesoro Público	Coloc-TP	3 050,0	<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	15 434,0	<a href="#">Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)</a>
Certificado de Depósito Reajutable	CDR	8 131,5	<a href="#">Circular 013-2012-BCRP (04/05/2012)</a>
Certificado de Depósito Tasa Variable	CDV	160,0	<a href="#">Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)</a>
Certificado de Depósito Liquidable en US\$	COLD	0,0	<a href="#">Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)</a>
<b>TOTAL</b>		<b>30 627,0</b>	

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

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
REPO Compra con Compromiso Recompra Títulos Valore	REP	300,0	<a href="#">Circular 051-2013-BCRP (27/12/2013)</a>
REPO Compra con Compromiso Recompra M.E.	SWAP	14 900,0	<a href="#">Circular 017-2014-BCRP (07/05/2014)</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	1 900,0	<a href="#">Circular 033-2015-BCRP (26/08/2015)</a>
<b>TOTAL</b>		<b>29 804,7</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	27 721,8	<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, 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.
- 10/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.