



Operaciones Monetarias y Cambiarias del 18 de Enero de 2011

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 10 955

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	CDV-43	CD-3191	DP-226	DP-227
Monto Subasta	300	30	300	7 000
Plazo	9 Meses	6 Meses	2 Meses	Overnight
Emisión	18-Ene-11	18-Ene-11	18-Ene-11	18-Ene-11
Vencimiento	18-Oct-11	11-Jul-11	17-Mar-11	19-Ene-11
Plazo en días	273	174	58	1
Hora cierre	12:45	13:15	13:30	14:00
Participantes	G-2	G-3	G-1	G-1
Montos				
Demandado	1 134,0	160,0	332,0	7 638,5
Aceptado	300,0	30,0	251,0	6 999,9
Tasas (%)				
Mínima	0,02	3,55	3,38	3,21
Máxima	0,04	3,60	3,40	3,25
Promedio	0,03	3,57	3,39	3,24
Precio (%)				
Mínimo	99,9735	98,3051		
Máximo	99,9886	98,3300		
Promedio	99,9773	98,3176		

III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

Operación	Monto	Tipo de cambio prom.
Compra/venta	Sin movim.	

IV. OPERACIONES DE VENTANILLA

Operación	Monto	Tasa
	Sin movim.	

V. DEPÓSITOS OVERNIGHT

Moneda	Monto	Tasas
Nacional (S/.)	0,0	2,45
Extranjera (US\$)	6,0	0,1611

VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	20 711,7	Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito	CD	120,0	Circular 034-2008-BCRP (15/08/2008)
Certificado de Depósito Tasa Variable	CDV	4 595,7	Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito Liquidable en US\$	CDLD	450,0	Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)
TOTAL		25 877,4	

VII. 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/ Entidades autorizadas mediante Circular 034-2008-BCRP.
- 4/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.