



Operaciones Monetarias y Cambiarias del 26 de Enero de 2011

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 9 125

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	CDV-49	CDLD-11	DP-233	DP-234
Monto Subasta	300	200	1 000	5 300
Plazo	9 Meses	2 Meses	1 Semana	Overnight
Emisión	26-Ene-11	26-Ene-11	26-Ene-11	26-Ene-11
Vencimiento	26-Oct-11	25-Mar-11	02-Feb-11	27-Ene-11
Plazo en días	273	58	7	1
Hora cierre	12:45	13:25	13:30	14:00
Participantes	G-2	G-4	G-1	G-1
Montos				
Demandado	930,0	161,0	1 164,8	5 885,7
Aceptado	300,0	131,0	944,8	5 300,0
Tasas (%)				
Mínima	0,06	3,22	3,24	3,22
Máxima	0,08	3,40	3,26	3,25
Promedio	0,08	3,30	3,25	3,24
Precio (%)				
Mínimo	99,9357	99,4628		
Máximo	99,9545	99,4907		
Promedio	99,9395	99,4780		

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\$)	411,2	0,1702

VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	18 356,5	Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito	CD	180,0	Circular 034-2008-BCRP (15/08/2008)
Certificado de Depósito Tasa Variable	CDV	6 145,7	Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito Liquidable en US\$	CDLD	1 001,0	Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)
TOTAL		25 683,2	

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/ El Grupo 3 (G-3) Incluye a las entidades autorizadas mediante Circular 034-2008-BCRP.
- 4/ El Grupo 4 (G-4) incluye a las empresas bancarias, según Art. 16 Ley 26702.
- 5/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.