



Operaciones Monetarias y Cambiarias del 24 de Noviembre de 2010

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 4 420

El monto considera las subastas realizadas antes del mediodía.

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	CDV-19	DP-135	DP-136	DP-137	DP-138
Monto Subasta	100	300	2 000	200	2 000
Plazo	6 meses	3 meses	O/N	4 meses	O/N
Emisión	24-Nov-10	24-Nov-10	24-Nov-10	24-Nov-10	24-Nov-10
Vencimiento	25-May-11	22-Feb-11	25-Nov-10	24-Mar-11	25-Nov-10
Plazo en días	182	90	1	120	1
Hora cierre	10:45	11:00	11:30	12:45	14:00
Participantes	G-2	G-1	G-1	G-1	G-1
Montos					
Demandado	463,0	700,0	2 468,0	376,0	1 452,5
Aceptado	100,0	300,0	2 000,0	200,0	1 452,5
Tasas (%)					
Mínima	0,08	3,15	2,97	3,17	2,95
Máxima	0,08	3,15	3,00	3,24	3,00
Promedio	0,08	3,15	2,99	3,22	2,99
Precio (%)					
Mínimo	99,9576				
Máximo	99,9596				
Promedio	99,9592				

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/.)	Sin movim.	2,2000
Extranjera (US\$)	1 694,6	0,1884

VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	23 092,8	Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito	CD	1 170,0	Circular 034-2008-BCRP (15/08/2008)
Certificado de Depósito Tasa Variable	CDV	1 722,9	Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito Liquidable en US\$	CDLD	450,0	Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)
TOTAL		26 435,7	

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/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.