



Operaciones Monetarias y Cambiarias del 25 de Noviembre de 2010

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 4 600

El monto considera las subastas realizadas antes del mediodía.

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento | CDV-20 | DP-139 | DP-140 | DP-141 | DP-142 |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Monto Subasta | 100 | 200 | 1 500 | 200 | 2 000 |
| Plazo | 6 meses | 4 meses | O/N | 3 meses | O/N |
| Emisión | 25-Nov-10 | 25-Nov-10 | 25-Nov-10 | 25-Nov-10 | 25-Nov-10 |
| Vencimiento | 26-May-11 | 24-Mar-11 | 26-Nov-10 | 23-Feb-11 | 26-Nov-10 |
| Plazo en días | 182 | 119 | 1 | 90 | 1 |
| Hora cierre | 10:45 | 11:00 | 11:30 | 13:15 | 14:00 |
| Participantes | G-2 | G-1 | G-1 | G-1 | G-1 |
| Montos | | | | | |
| Demandado | 437,4 | 400,0 | 2 285,0 | 320,0 | 2 028,8 |
| Aceptado | 100,0 | 200,0 | 1 499,8 | 250,0 | 2 000,0 |
| Tasas (%) | | | | | |
| Mínima | 0,07 | 3,23 | 2,97 | 3,14 | 2,95 |
| Máxima | 0,08 | 3,23 | 3,00 | 3,14 | 3,00 |
| Promedio | 0,08 | 3,23 | 2,99 | 3,14 | 2,99 |
| Precio (%) | | | | | |
| Mínimo | 99,9601 | | | | |
| Máximo | 99,9640 | | | | |
| Promedio | 99,9613 | | | | |

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\$) | 1 424,5 | 0,1884 |

VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|--|--------|-----------------|-------------------------------------|
| Depósito a plazo | DP | 23 590,1 | 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 | 1 822,9 | Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Certificado de Depósito Liquidable en US\$ | CDLD | 450,0 | Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010) |
| TOTAL | | 27 033,0 | |

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.