



Operaciones Monetarias y Cambiarias del 29 de Noviembre de 2010

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 4 710

El monto considera las subastas realizadas antes del mediodía.

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	CDV-22	DP-147	DP-148	DP-149	DP-150
Monto Subasta	100	200	2 000	100	3 600
Plazo	6 meses	4 meses	O/N	2 meses	O/N
Emisión	29-Nov-10	29-Nov-10	29-Nov-10	29-Nov-10	29-Nov-10
Vencimiento	30-May-11	24-Mar-11	30-Nov-10	01-Feb-11	30-Nov-10
Plazo en días	182	115	1	64	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	413,0	281,4	2 482,8	162,0	3 243,5
Aceptado	100,0	200,1	2 000,1	100,0	3 243,5
Tasas (%)					
Mínima	0,04	3,22	2,99	3,06	2,92
Máxima	0,07	3,22	3,00	3,07	3,00
Promedio	0,04	3,22	2,99	3,07	2,99
Precio (%)					
Mínimo	99,9650				
Máximo	99,9798				
Promedio	99,9788				

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/.)	5,3	2,20
Extranjera (US\$)	813,7	0,1950

VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	24 137,6	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	2 022,9	Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito Liquidable en US\$	CDLD	450,0	Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)
TOTAL		27 780,5	

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.