



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 14 de Diciembre de 2010

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 7 635

El monto considera las subastas realizadas antes del mediodía.

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento | CDV-29 | DP-169 | DP-170 | DP-171 | DP-172 |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Monto Subasta | 100 | 3 000 | 200 | 1 000 | 1 900 |
| Plazo | 6 Meses | Overnight | 3 Meses | 1 Mes | Overnight |
| Emisión | 14-Dic-10 | 14-Dic-10 | 14-Dic-10 | 14-Dic-10 | 14-Dic-10 |
| Vencimiento | 13-Jun-11 | 15-Dic-10 | 14-Mar-11 | 13-Ene-11 | 15-Dic-10 |
| Plazo en días | 181 | 1 | 90 | 30 | 1 |
| Hora cierre | 10:45 | 11:30 | 13:00 | 13:30 | 14:00 |
| Participantes | G-2 | G-1 | G-1 | G-1 | G-1 |
| Montos | | | | | |
| Demandado | 369,0 | 3 849,0 | 350,0 | 820,0 | 1 986,3 |
| Aceptado | 194,0 | 2 999,9 | 250,0 | 770,0 | 1 900,0 |
| Tasas (%) | | | | | |
| Mínima | 0,09 | 2,90 | 3,16 | 3,02 | 2,94 |
| Máxima | 0,09 | 2,99 | 3,16 | 3,05 | 3,00 |
| Promedio | 0,09 | 2,98 | 3,16 | 3,04 | 2,98 |
| Precio (%) | | | | | |
| Mínimo | 99,9523 | | | | |
| Máximo | 99,9528 | | | | |
| Promedio | 99,9524 | | | | |

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/.) | 2,4 | 2,20 |
| Extranjera (US\$) | 75,0 | 0,1774 |

VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|--|--------|-----------------|---|
| Depósito a plazo | DP | 20 429,3 | Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Certificado de Depósito | CD | 520,0 | Circular 034-2008-BCRP (15/08/2008) |
| Certificado de Depósito Tasa Variable | CDV | 2 816,8 | Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Certificado de Depósito Liquidable en US\$ | CDLD | 450,0 | Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010) |
| TOTAL | | 24 216,1 | |

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.