



# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

## Operaciones Monetarias y Cambiarias del 27 de Diciembre de 2010

Cifras en millones y tasas en porcentajes

### I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 6 530

El monto considera las subastas realizadas antes del mediodía.

### II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento       | DP-192    | DP-193    | DP-194    |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|
| Monto Subasta     | 5 000     | 500       | 3 300     |
| Plazo             | Overnight | 1 Semana  | Overnight |
| Emisión           | 27-Dic-10 | 27-Dic-10 | 27-Dic-10 |
| Vencimiento       | 28-Dic-10 | 03-Ene-11 | 28-Dic-10 |
| Plazo en días     | 1         | 7         | 1         |
| Hora cierre       | 11:30     | 13:00     | 14:00     |
| Participantes     | G-1       | G-1       | G-1       |
| <b>Montos</b>     |           |           |           |
| Demandado         | 6 012,4   | 817,8     | 2 969,3   |
| Aceptado          | 4 999,9   | 500,0     | 2 969,3   |
| <b>Tasas (%)</b>  |           |           |           |
| Mínima            | 2,98      | 3,00      | 2,92      |
| Máxima            | 3,00      | 3,01      | 3,00      |
| Promedio          | 3,00      | 3,01      | 2,99      |
| <b>Precio (%)</b> |           |           |           |
| Mínimo            |           |           |           |
| Máximo            |           |           |           |
| Promedio          |           |           |           |

### 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/.)    | 3,0     | 2,20   |
| Extranjera (US\$) | 1 182,2 | 0,1941 |

### VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

| Instrumentos                               | Código | Saldo           | Circular Vigente                                    |
|--|--------|-----------------|---|
| Depósito a plazo                           | DP     | 19 999,8        | <a href="#">Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)</a> |
| Certificado de Depósito                    | CD     | 30,0            | <a href="#">Circular 034-2008-BCRP (15/08/2008)</a> |
| Certificado de Depósito Tasa Variable      | CDV    | 3 195,8         | <a href="#">Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)</a> |
| Certificado de Depósito Liquidable en US\$ | CDLD   | 450,0           | <a href="#">Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)</a> |
| <b>TOTAL</b>                               |        | <b>23 675,6</b> |   |

### 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.