



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 07 de febrero de 2011

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 10 085

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento | CDV-55 | CDLD-18 | DP-240 |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|
| Monto Subasta | 200 | 150 | 3 100 |
| Plazo | 9 Meses | 2 Meses | Overnight |
| Emisión | 07-feb-11 | 07-feb-11 | 07-feb-11 |
| Vencimiento | 04-nov-11 | 08-abr-11 | 08-feb-11 |
| Plazo en días | 270 | 60 | 1 |
| Hora cierre | 12:45 | 13:00 | 14:00 |
| Participantes | G-2 | G-4 | G-1 |
| Montos | | | |
| Demandado | 405,0 | 345,0 | 3 470,9 |
| Aceptado | 200,0 | 150,0 | 3 099,9 |
| Tasas (%) | | | |
| Mínima | 0,10 | 3,31 | 3,19 |
| Máxima | 0,10 | 3,31 | 3,25 |
| Promedio | 0,10 | 3,31 | 3,23 |
| Precio (%) | | | |
| Mínimo | 99,9253 | 99,4588 | |
| Máximo | 99,9258 | 99,4588 | |
| Promedio | 99,9254 | 99,4588 | |

III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

| Operación | Monto | Tipo de cambio prom. |
|--------------|-------|----------------------|
| Compra/venta | 159 | 2,766 |

IV. OPERACIONES DE VENTANILLA

| Operación | Monto | Tasa |
|-----------|------------|------|
| | Sin movim. | |

V. DEPÓSITOS OVERNIGHT

| Moneda | Monto | Tasas |
|-------------------|-------|--------|
| Nacional (S/.) | 0,0 | 2,45 |
| Extranjera (US\$) | 1,4 | 0,1709 |

VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|--|--------|-----------------|---|
| Depósito a plazo | DP | 14 111,6 | Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Certificado de Depósito | CD | 270,0 | Circular 034-2008-BCRP (15/08/2008) |
| Certificado de Depósito Tasa Variable | CDV | 6 945,7 | Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Certificado de Depósito Liquidable en US\$ | CDLD | 991,0 | Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010) |
| TOTAL | | 22 318,3 | |

VII. INFORMES

Departamento de Operaciones Monetarias y Cambiarias
Teléfonos 613-2000 Anexos: 4521, 4561, 4527
Facsimil 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/ El Grupo 3 (G-3) Incluye a las entidades autorizadas mediante Circular 034-2008-BCRP.
- 4/ El Grupo 4 (G-4) incluye a las empresas bancarias, según Art. 16 Ley 26702.
- 5/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.