



# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

## Operaciones Monetarias y Cambiarias del 11 de febrero de 2011

Cifras en millones y tasas en porcentajes

### I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 15 680

### II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento       | CDV-58    | DP-244    | DP-245    |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|
| Monto Subasta     | 200       | 700       | 10 700    |
| Plazo             | 9 Meses   | 1 Mes     | Overnight |
| Emisión           | 11-feb-11 | 11-feb-11 | 11-feb-11 |
| Vencimiento       | 09-nov-11 | 11-mar-11 | 14-feb-11 |
| Plazo en días     | 271       | 28        | 3         |
| Hora cierre       | 12:45     | 13:30     | 14:00     |
| Participantes     | G-2       | G-1       | G-1       |
| <b>Montos</b>     |           |           |           |
| Demandado         | 440,5     | 1 526,5   | 11 741,6  |
| Aceptado          | 200,0     | 424,5     | 10 700,2  |
| <b>Tasas (%)</b>  |           |           |           |
| Mínima            | 0,09      | 3,51      | 3,25      |
| Máxima            | 0,09      | 3,55      | 3,50      |
| Promedio          | 0,09      | 3,53      | 3,46      |
| <b>Precio (%)</b> |           |           |           |
| Mínimo            | 99,9324   |           |           |
| Máximo            | 99,9324   |           |           |
| Promedio          | 99,9324   |           |           |

### III. OPERACIONES CAMBIARIAS (En US\$)

| Operación    | Monto | Tipo de cambio prom. |
|--------------|-------|----------------------|
| Compra/venta | 130   | 2,7658               |

### IV. OPERACIONES DE VENTANILLA

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

### V. DEPÓSITOS OVERNIGHT

| Moneda            | Monto | Tasas  |
|-------------------|-------|--------|
| Nacional (S/.)    | 0,0   | 2,70   |
| Extranjera (US\$) | 1,5   | 0,1595 |

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

| Instrumentos                               | Código | Saldo           | Circular Vigente                                    |
|--|--------|-----------------|---|
| Depósito a plazo                           | DP     | 17 231,4        | <a href="#">Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)</a> |
| Certificado de Depósito                    | CD     | 330,0           | <a href="#">Circular 034-2008-BCRP (15/08/2008)</a> |
| Certificado de Depósito Tasa Variable      | CDV    | 7 545,7         | <a href="#">Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)</a> |
| Certificado de Depósito Liquidable en US\$ | CDLD   | 991,0           | <a href="#">Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)</a> |
| <b>TOTAL</b>                               |        | <b>26 098,1</b> |   |

### 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.