



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 18 de Febrero de 2011

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 12 560

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento | CDV-62 | DP-254 | DP-255 |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|
| Monto Subasta | 300 | 1 000 | 9 000 |
| Plazo | 9 Meses | 2 Semanas | Overnight |
| Emisión | 18-Feb-11 | 18-Feb-11 | 18-Feb-11 |
| Vencimiento | 15-Nov-11 | 04-Mar-11 | 21-Feb-11 |
| Plazo en días | 270 | 14 | 3 |
| Hora cierre | 12:30 | 13:30 | 14:00 |
| Participantes | G-5 | G-1 | G-1 |
| Montos | | | |
| Demandado | 690,0 | 1 832,0 | 9 490,2 |
| Aceptado | 300,0 | 1 000,1 | 8 999,9 |
| Tasas (%) | | | |
| Mínima | 0,08 | 3,50 | 3,41 |
| Máxima | 0,08 | 3,50 | 3,50 |
| Promedio | 0,08 | 3,50 | 3,49 |
| Precio (%) | | | |
| Mínimo | 99,9401 | | |
| Máximo | 99,9401 | | |
| Promedio | 99,9401 | | |

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/.) | 0,0 | 2,70 |
| Extranjera (US\$) | 1,0 | 0,1585 |

VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|--|--------|-----------------|---|
| Depósito a plazo | DP | 17 952,5 | Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Certificado de Depósito | CD | 410,0 | Circular 034-2008-BCRP (15/08/2008) |
| Certificado de Depósito Tasa Variable | CDV | 8 555,7 | Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Certificado de Depósito Liquidable en US\$ | CDLD | 991,0 | Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010) |
| TOTAL | | 27 909,2 | |

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/ 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/ El Grupo 5 (G-5) incluye a las empresas de operaciones múltiples autorizadas a captar depósitos del público, según Art. 16 Ley 26702, sociedades administradoras de fondos mutuos y administradoras de fondos de pensiones.
- 6/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.