



Operaciones Monetarias y Cambiarias del 14 de Enero de 2011

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 12 775

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento | CDV-41 | DP-221 | DP-222 | DP-223 |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Monto Subasta | 200 | 200 | 500 | 8 000 |
| Plazo | 9 Meses | 3 Meses | 2 Meses | Overnight |
| Emisión | 14-Ene-11 | 14-Ene-11 | 14-Ene-11 | 14-Ene-11 |
| Vencimiento | 14-Oct-11 | 14-Abr-11 | 14-Mar-11 | 17-Ene-11 |
| Plazo en días | 273 | 90 | 59 | 3 |
| Hora cierre | 13:00 | 13:15 | 13:30 | 14:00 |
| Participantes | G-2 | G-1 | G-1 | G-1 |
| Montos | | | | |
| Demandado | 962,0 | 495,0 | 1 051,0 | 7 912,6 |
| Aceptado | 200,0 | Desierta | 1 000,0 | 7 912,6 |
| Tasas (%) | | | | |
| Mínima | 0,04 | | 3,35 | 3,20 |
| Máxima | 0,05 | | 3,35 | 3,25 |
| Promedio | 0,04 | | 3,35 | 3,24 |
| Precio (%) | | | | |
| Mínimo | 99,9644 | | | |
| Máximo | 99,9697 | | | |
| Promedio | 99,9676 | | | |

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/.) | 2,3 | 2,45 |
| Extranjera (US\$) | 21,0 | 0,1612 |

VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|--------------------------------------------|--------|-----------------|-----------------------------------------------------|
| Depósito a plazo | DP | 21 189,4 | Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Certificado de Depósito | CD | 90,0 | Circular 034-2008-BCRP (15/08/2008) |
| Certificado de Depósito Tasa Variable | CDV | 4 095,7 | Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Certificado de Depósito Liquidable en US\$ | CDLD | 450,0 | Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010) |
| TOTAL | | 25 825,1 | |

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.