



Operaciones Monetarias y Cambiarias del 27 de Enero de 2011

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 8 205

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	CDLD-12	CDV-50	CD-3194	CDLD-13	DP-235
Monto Subasta	100	300	30	50	5 400
Plazo	2 Meses	9 Meses	1 Año	2 Meses	Overnight
Emisión	27-Ene-11	27-Ene-11	27-Ene-11	27-Ene-11	27-Ene-11
Vencimiento	28-Mar-11	27-Oct-11	13-Ene-12	28-Mar-11	28-Ene-11
Plazo en días	60	273	351	60	1
Hora cierre	11:00	12:45	13:15	13:29	14:00
Participantes	G-4	G-2	G-3	G-4	G-1
Montos					
Demandado	215,0	555,0	156,0	80,0	5 945,8
Aceptado	100,0	300,0	30,0	Desierta	5 400,0
Tasas (%)					
Mínima	3,40	0,08	4,00		3,21
Máxima	3,40	0,10	4,00		3,25
Promedio	3,40	0,09	4,00		3,24
Precio (%)					
Mínimo	99,4444	99,9243	96,2482		
Máximo	99,4444	99,9394	96,2482		
Promedio	99,4444	99,9303	96,2482		

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	2,45
Extranjera (US\$)	487,8	0,1699

VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	18 456,5	Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito	CD	210,0	Circular 034-2008-BCRP (15/08/2008)
Certificado de Depósito Tasa Variable	CDV	6 145,7	Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito Liquidable en US\$	CDLD	1 101,0	Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)
TOTAL		25 913,2	

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/ En las subastas se aceptará un número máximo de diez propuestas.