



Operaciones Monetarias y Cambiarias del 04 de febrero de 2011

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 8 955

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

Instrumento	CDV-54	CDLD-17	DP-239
Monto Subasta	100	100	1 300
Plazo	9 Meses	2 Meses	Overnight
Emisión	04-feb-11	04-feb-11	04-feb-11
Vencimiento	03-nov-11	04-abr-11	07-feb-11
Plazo en días	272	59	3
Hora cierre	12:45	13:00	14:00
Participantes	G-2	G-4	G-1
<u>Montos</u>			
Demandado	220,0	25,0	2 018,4
Aceptado	100,0	Desierta	1 300,0
<u>Tasas (%)</u>			
Mínima	0,09		3,13
Máxima	0,10		3,24
Promedio	0,10		3,21
<u>Precio (%)</u>			
Mínimo	99,9245		
Máximo	99,9320		
Promedio	99,9260		

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/.)	24	2,45
Extranjera (US\$)	1,2	0,1712

VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

Instrumentos	Código	Saldo	Circular Vigente
Depósito a plazo	DP	13 311,7	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	6 745,7	Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010)
Certificado de Depósito Liquidable en US\$	CDLD	991,0	Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010)
TOTAL		21 318,4	

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.