



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

Operaciones Monetarias y Cambiarias del 15 de marzo de 2011

Cifras en millones y tasas en porcentajes

I. LA LIQUIDEZ INICIAL EN LA BANCA SE ESTIMA EN S/. 12 030

II. SUBASTAS (En Nuevos Soles)

| Instrumento | CD-3207 | DP-278 | DP-279 | DP-280 |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Monto Subasta | 50 | 1 000 | 1 000 | 7 200 |
| Plazo | 6 Meses | 1 Mes | 2 Semanas | Overnight |
| Emisión | 15-mar-11 | 15-mar-11 | 15-mar-11 | 15-mar-11 |
| Vencimiento | 13-sep-11 | 15-abr-11 | 29-mar-11 | 16-mar-11 |
| Plazo en días | 182 | 31 | 14 | 1 |
| Hora cierre | 12:00 | 13:00 | 13:15 | 14:00 |
| Participantes | G-3 | G-1 | G-1 | G-1 |
| Montos | | | | |
| Demandado | 176,7 | 1 240,0 | 2 015,0 | 8 029,2 |
| Aceptado | 50,0 | 1 000,1 | 1 000,0 | 7 200,2 |
| Tasas (%) | | | | |
| Mínima | 4,00 | 3,77 | 3,75 | 3,71 |
| Máxima | 4,15 | 3,77 | 3,76 | 3,75 |
| Promedio | 4,04 | 3,77 | 3,76 | 3,74 |
| Precio (%) | | | | |
| Mínimo | 97,9668 | | | |
| Máximo | 98,0367 | | | |
| Promedio | 98,0162 | | | |

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 | 2,95 |
| Extranjera (US\$) | 1,4 | 0,1486 |

VI. SALDOS POR INSTRUMENTOS (En Nuevos Soles)

| Instrumentos | Código | Saldo | Circular Vigente |
|--|--------|-----------------|---|
| Depósito a plazo | DP | 14 340,0 | Circular 035-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Certificado de Depósito | CD | 700,0 | Circular 034-2008-BCRP (15/08/2008) |
| Certificado de Depósito Tasa Variable | CDV | 10 855,7 | Circular 036-2010-BCRP (05/10/2010) |
| Certificado de Depósito Liquidable en US\$ | CDLD | 991,0 | Circular 037-2010-BCRP (05/10/2010) |
| TOTAL | | 26 886,7 | |

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.