

| BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ | | | | | |
|--|-----------------|-----------------|---------------------------|---------------------------|-----------------|
| RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS | | | | | |
| (Millones S/.) | | | | | |
| | 17 Julio | 18 Julio | 19 Julio | 20 Julio | 21 Julio |
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCF | -399,1 | -441,9 | -431,1 | -633,8 | -643,0 |
| 2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones | | | | | |
| a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR | | | | | |
| i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | | | | |
| Saldo | 3 224,1 | 3 224,1 | 3 224,1 | 3 224,1 | 3 224,1 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (4 de agosto de 2006) | | | | | 425,0 |
| Vencimientos de CDBCRP el 19 al 21 de julio de 2006 | | | | | 0,0 |
| ii. Subasta de compra temporal de valores | 300,0 | 455,0 | 200,0 280,0 | 150,0 540,0 | 700,0 |
| Propuestas recibidas | 300,0 | 455,0 | 300,0 | 150,0 | 772,0 |
| Plazo de vencimiento | | | 1 día | 2 semanas | 1 día |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,48/4,48/4,48 | 4,46/4,51/4,50 | 4,58/4,58/4,58 | 4,45/4,50/4,49 | 4,58/4,58/4,58 |
| Saldo | 1 600,6 | 1 755,6 | 1 780,6 | 2 190,6 | 2 350,6 |
| iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | | | | |
| Saldo | 670,0 | 670,0 | 670,0 | 670,0 | 670,0 |
| Próximo vencimiento de CDRBCRP (13 de diciembre de 2006) | | | | | 270,0 |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | 124,7 | 168,5 | 0,0 | 56,7 | 0,0 |
| i. Compras (millones de US\$) | 38,5 | 52,0 | 0,0 | 17,5 | 0,0 |
| Tipo de cambio promedio | 3,2400 | 3,2405 | | 3,2406 | |
| ii. Ventas (millones de US\$) | | | | | |
| Tipo de cambio promedio | | | | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 25,6 | 181,6 | 48,9 | 112,9 | 57,0 |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.) | | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0078% | 0,0078% | 0,0078% | 0,0078% | 0,0078% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | | | | | |
| Tasa de interés | 5,25% | 5,25% | 5,25% | 5,25% | 5,25% |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | | |
| Tasa de interés | 5,25% | 5,25% | 5,25% | 5,25% | 5,25% |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Tasa de interés | 3,75% | 3,75% | 3,75% | 3,75% | 3,75% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 25,6 | 181,6 | 48,9 | 112,9 | 57,0 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 1 513,3 | 1 502,1 | 1 485,2 | 1 473,1 | 1 459,6 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 7,8 | 7,8 | 7,7 | 7,6 | 7,6 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 381,9 | 370,8 | 353,8 | 341,8 | 328,2 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 2,0 | 1,9 | 1,8 | 1,8 | 1,7 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 255,3 | 101,0 | 144,0 | 112,0 | 200,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,45/4,60/4,47 | 4,45/4,50/4,49 | 4,50/4,55/4,52 | 4,50/4,55/4,53 | 4,50/4,55/4,52 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 7,5 | 8,0 | 8,0 | 9,0 | 9,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 5,23/5,23/5,23 | 5,23/5,23/5,23 | 5,23/5,23/5,23 | 5,23/5,23/5,23 | 5,23/5,23/5,23 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 14 Julio | 17 Julio | 18 Julio | 19 Julio | 20 Julio |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | -9,5 | -11,1 | -27,3 | 24,5 | 15,7 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | -23,4 | -27,1 | -50,9 | 34,6 | 13,8 |
| a. Mercado spot con el público | 67,1 | 17,5 | 13,3 | 21,6 | 33,6 |
| i. Compras | 134,3 | 92,2 | 75,0 | 84,0 | 122,5 |
| ii. (-) Ventas | 67,2 | 74,7 | 61,8 | 62,4 | 88,9 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | 41,3 | -55,8 | 37,4 | 99,0 | -3,1 |
| i. Pactadas | 72,2 | 37,4 | 74,6 | 143,5 | 116,2 |
| ii. (-) Vencidas | 30,9 | 93,2 | 37,2 | 44,5 | 119,2 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 27,4 | -71,9 | 13,8 | 109,1 | -4,9 |
| i. Pactadas | 81,8 | 79,4 | 93,9 | 180,6 | 241,9 |
| ii. (-) Vencidas | 54,4 | 151,2 | 80,1 | 71,5 | 246,8 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 15,0 | 40,5 | 24,5 | 72,0 | 110,0 |
| ii. A futuro | 0,0 | 0,0 | 19,0 | 41,5 | 6,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 19,0 | 49,4 | 31,8 | 26,0 | 125,8 |
| i. Compras | 21,5 | 141,5 | 68,8 | 70,0 | 245,0 |
| ii. (-) Ventas | 2,5 | 92,1 | 37,0 | 44,0 | 119,2 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -86,0 | -36,0 | -53,0 | 14,0 | -18,0 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,240 | 3,240 | 3,240 | 3,242 | 3,240 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |