



Al: 14-Oct-2009

## M&M DIARIO

### TIPO DE CAMBIO

| Fecha       | Compra | Venta |
|-------------|--------|-------|
| 14-Oct-2009 | 6.97   | 7.07  |

### BOLSIN

| Demanda | 13-Oct-2009 | Venta Efectiva | 14-Oct-2009 |
|---------|-------------|----------------|-------------|
|         | 0           | 0              |             |

### UFV

1.53541

## I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

### A. OPERACIONES DE REPORTEO

#### i. Operaciones de Reporteo vigentes

| Moneda            | F. Operación | T. Premio % | Monto | Plazo | F. Venc. |
|-------------------|--------------|-------------|-------|-------|----------|
| MN                | -            | -           | -     | -     | -        |
| Total Vigente Bs. |              |             | 0.00  |       |          |

| Moneda              | F. Operación | T. Premio % | Monto | Plazo | F. Venc. |
|---------------------|--------------|-------------|-------|-------|----------|
| ME                  | -            | -           | -     | -     | -        |
| Total Vigente \$us. |              |             | 0.00  |       |          |

#### ii. Oferta diaria máxima de Reportos

(\*) Vigente del 08/10/2009 al 21/10/2009

| Moneda | Saldo Diario Disponible | Tasa Subasta (*) | TEA a) Subasta | Tasa Mesa b) | TEA a) Mesa | Plazo Máximo | Tasa de Valoración c) |
|--------|-------------------------|------------------|----------------|--------------|-------------|--------------|-----------------------|
| MN     | 25,000,000.00           | 3.00%            | 3.04%          | 3.50%        | 3.56%       | 15           | 8.00%                 |
| ME     | 5,000,000.00            | 8.75%            | 9.13%          | 9.25%        | 9.67%       | 15           | 17.25%                |

a) TEA referencial calculada para un plazo de 15 días.

b) 50 puntos básicos sobre la tasa de subasta.

c) Tasa de valoración utilizada para determinar el valor de ida de una operación de reporte con colaterales en MN y ME, para colaterales en UFV es 6%

#### iii. Saldo vigente máximo para Reportos

(\*) Vigente del 08/10/2009 al 21/10/2009

| Moneda | Saldo Semanal  | Tasa Subasta (*) | TEA a) Subasta | Tasa Mesa b) | TEA a) Mesa | Plazo Máximo |
|--------|----------------|------------------|----------------|--------------|-------------|--------------|
| MN     | 125,000,000.00 | 3.00%            | 3.04%          | 3.50%        | 3.56%       | 15           |
| ME     | 25,000,000.00  | 8.75%            | 9.13%          | 9.25%        | 9.67%       | 15           |

a) TEA referencial calculada para un plazo de 15 días.

b) 50 puntos básicos sobre la tasa de subasta.

#### iv. Créditos con garantía en el Fondo RAL

| Tramos | MN    | TEA a) | ME     | TEA a) |
|--------|-------|--------|--------|--------|
| 1er    | 4.50% | 4.60%  | 10.25% | 10.78% |
| 2do    | 5.00% | 5.12%  | 10.75% | 11.34% |

(i) Estas operaciones se realizan directamente con la Gerencia de Entidades Financieras del BCB.

a) TEA calculada para un plazo de 7 días.

## B. SUBASTA PÚBLICA DE VALORES PÚBLICOS Y SERVICIOS DE DEPÓSITOS BANCARIOS

### i. Subasta Electrónica de Valores Públicos 43/2009

Miércoles 21/10/2009 Apertura: Hrs.9:00 am.

| Valor       | Emisor | Cierre | Moneda     | Plazo | Modalidad   | Cantidad |
|-------------|--------|--------|------------|-------|-------------|----------|
| LT-ME       | BCB    | 09:10  | ME         | 91    | Competitiva | 100      |
| LT-MU       | BCB    | 09:20  | MN-UFV (*) | 364   | Competitiva | 20,000   |
| LT-MN       | BCB    | 09:30  | MN         | 91    | Competitiva | 30,000   |
| LT-MN       | BCB    | 09:40  | MN         | 182   | Competitiva | 30,000   |
| LT-MN       | BCB    | 09:50  | MN         | 364   | Competitiva | 30,000   |
| BT-MN 7,00% | TGN    | 10:00  | MN         | 728   | Competitiva | 1,000    |
| BT-MN 7,50% | TGN    | 10:10  | MN         | 1,456 | Competitiva | 1,000    |
| BT-MN 7,80% | TGN    | 10:20  | MN         | 2,184 | Competitiva | 1,000    |
| BT-MN 8,00% | TGN    | 10:30  | MN         | 2,912 | Competitiva | 2,000    |
| BT-MN 8,20% | TGN    | 10:40  | MN         | 3,640 | Competitiva | 5,000    |
| BT-MN 8,60% | TGN    | 10:50  | MN         | 5,460 | Competitiva | 10,000   |
| BT-MN 8,80% | TGN    | 11:00  | MN         | 7,280 | Competitiva | 30,000   |

(\*) Valores en Moneda Nacional indexada a la Unidad de Fomento de Vivienda (UFV).

#### ii. Subasta para Servicio Extendido de Depósitos Bancarios (SED-ME)

No existe oferta para SED-ME

#### iii. Subasta para Servicio Restringido de Depósitos Bancarios (SRD-ME)

No existe oferta de depósitos.

#### iv. Créditos con cargo al Servicio Extendido de Depósitos (SED-ME)

| Tasa   | Plazo  |
|--------|--------|
| 10.25% | 7 días |

## II MERCADO MONETARIO

### A. OPERACIONES INTERBANCARIAS CON PLAZO HASTA 30 DÍAS (en miles)

| Fecha al: | i) Moneda Nacional |      |       |             |       | ii) Moneda Extranjera |       |       |             |       |
|-----------|--------------------|------|-------|-------------|-------|-----------------------|-------|-------|-------------|-------|
|           | Min.               | Max. | Prom. | Plazo Prom. | Monto | Min.                  | Max.  | Prom. | Plazo Prom. | Monto |
| 07-Oct    | -                  | -    | -     | -           | -     | 0.75%                 | 0.75% | 0.75% | 2           | 8,000 |
| 08-Oct    | -                  | -    | -     | -           | -     | 0.75%                 | 0.75% | 0.75% | 1           | 5,000 |
| 09-Oct    | -                  | -    | -     | -           | -     | 0.75%                 | 0.75% | 0.75% | 3           | 5,000 |
| 12-Oct    | -                  | -    | -     | -           | -     | -                     | -     | -     | -           | -     |
| 13-Oct    | -                  | -    | -     | -           | -     | -                     | -     | -     | -           | -     |

### B. OPERACIONES INTERBANCARIAS CON PLAZO MAYOR A 30 DÍAS Y OTRAS OPERACIONES (\*) (en miles)

| Fecha al: | i) Moneda Nacional |      |       |             |       | ii) Moneda Extranjera |      |       |             |       |
|-----------|--------------------|------|-------|-------------|-------|-----------------------|------|-------|-------------|-------|
|           | Min.               | Max. | Prom. | Plazo Prom. | Monto | Min.                  | Max. | Prom. | Plazo Prom. | Monto |
| 07-Oct    | -                  | -    | -     | -           | -     | -                     | -    | -     | -           | -     |
| 08-Oct    | -                  | -    | -     | -           | -     | -                     | -    | -     | -           | -     |
| 09-Oct    | -                  | -    | -     | -           | -     | -                     | -    | -     | -           | -     |
| 12-Oct    | -                  | -    | -     | -           | -     | -                     | -    | -     | -           | -     |
| 13-Oct    | -                  | -    | -     | -           | -     | -                     | -    | -     | -           | -     |

(\*) Incluye operaciones de Banco Los Andes, Banco Solidario, Mutuales y FFPs

### C. OPERACIONES INTERBANCARIAS EN MONEDA NACIONAL - UFV

| A la fecha | Min. | Max. | Prom. | Plazo Prom. | Monto |
|------------|------|------|-------|-------------|-------|
| 07-Oct     | -    | -    | -     | -           | -     |
| 08-Oct     | -    | -    | -     | -           | -     |
| 09-Oct     | -    | -    | -     | -           | -     |
| 12-Oct     | -    | -    | -     | -           | -     |
| 13-Oct     | -    | -    | -     | -           | -     |

### D. OTRAS OPERACIONES INTERBANCARIAS EN MONEDA NACIONAL - UFV (\*)

| A la fecha | Min. | Max. | Prom. | Plazo Prom. | Monto |
|------------|------|------|-------|-------------|-------|
| 07-Oct     | -    | -    | -     | -           | -     |
| 08-Oct     | -    | -    | -     | -           | -     |
| 09-Oct     | -    | -    | -     | -           | -     |
| 12-Oct     | -    | -    | -     | -           | -     |
| 13-Oct     | -    | -    | -     | -           | -     |

(\*) Incluye operaciones de Banco Los Andes, Banco Solidario, Mutuales y FFPs

## III. INDICADORES MACROECONOMICOS (En Millones)

| Fecha al: | Emisión   | Reservas    | Dep. Banc. | Dep. No Banc. |
|-----------|-----------|-------------|------------|---------------|
|           | Bs.       | \$us        | \$us       | \$us          |
| 07-Oct    | 16,135.20 | 8,483.20    | 6,444.10   | 1,506.80      |
| 08-Oct    | 16,168.20 | 8,483.20    | 6,437.30   | 1,510.00      |
| 09-Oct    | 16,237.70 | 8,565.40    | 6,418.30   | 1,509.50      |
| 12-Oct    | 16,284.60 | 8,545.70    | 6,388.20   | 1,507.60      |
| 13-Oct    | 16,306.80 | 8,562.8 (p) | n.d.       | n.d.          |

(n.d.) No disponible

(p) Dato preliminar

| Fecha al: | Encaje diario - Excedente (Deficiencia) |        |       |         |       |      | Encaje Promedio - Excedente (Deficiencia) |        |       |         |       |       |
|-----------|---|--------|-------|---------|-------|------|---|--------|-------|---------|-------|-------|
|           | EFECTIVO                                |        |       | TITULOS |       |      | EFECTIVO                                  |        |       | TITULOS |       |       |
|           | MN                                      | ME     | MUFV  | MN      | ME    | MUFV | MN  | ME     | MUFV  | MN      | ME    | MUFV  |
| 07-Oct    | 4,951.93                                | 112.48 | 29.76 | -61.88  | 11.45 | 0    | 4,742.71                                  | 115.78 | 32.58 | -17.28  | 2.04  | -0.01 |
| 08-Oct    | 4,933.38                                | 109.06 | 30.10 | 27.80   | -8.33 | 1    | 4,761.78                                  | 115.11 | 32.33 | -12.77  | 1.00  | 0.09  |
| 09-Oct    | 5,009.72                                | 113.20 | 29.92 | 25.97   | -9.12 | 1    | 4,784.32                                  | 114.93 | 32.11 | -9.25   | 0.08  | 0.13  |
| 12-Oct    | 4,918.76                                | 104.37 | 29.97 | 39.08   | -1.99 | 0    | 4,826.12                                  | 113.93 | 31.64 | -0.76   | -1.38 | 0.17  |
| 13-Oct    | 4,951.81                                | 116.96 | 30.84 | -6.19   | -0.59 | -3   | 4,951.81                                  | 116.96 | 30.84 | -6.19   | -0.59 | -3.47 |

(p) datos preliminares.

## IV MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

### A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO

| Plazo semanas | EEUU      | Arg \$    | Chile \$  | Méx MN(m) | Libor     |
|---------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
|               | 13-Oct-09 | 13-Oct-09 | 13-Oct-09 | 13-Oct-09 | 13-Oct-09 |
| 4             | 0.05 ↑    | -         | 0.39 ↑    | n.d.      | 0.245 ↑   |
| 13            | 0.06      | 14.18 ↑   | -         | n.d.      | 0.284     |
| 26            | 0.13 ↓    | 15.50 ↑   | -         | 4.04      | 0.596 ↓   |
| 36            | -         | -         | -         | -         | -         |
| 52            | -         | -         | -         | n.d.      | 1.239 ↓   |
| 104           | -         | -         | -         | -         | -         |
| Prime Rate    | 3.25      |           |           |           |           |
| Fed Funds     | 0.12      |           |           |           |           |

(m) Mercado Secundario

### B. TIPOS DE CAMBIO

| TIPO DE CAMBIO (e) al 13/10/2009 |           |               |          |
|----------------------------------|-----------|---------------|----------|
| Argentina                        | 3.827 ↑   | Japón         | 89.728 ↑ |
| Reino Unido                      | 0.629 ↓   | México        | 13.158 ↓ |
| Brasil                           | 1.726 ↓   | Perú          | 2.858 ↑  |
| Chile                            | 555.150 ↑ | Unión Europea | 0.6744 ↓ |

(e) Respecto al dólar

## V AVISO IMPORTANTE

### Comunicado 08/2009

Por decisión del Comité de Operaciones de Mercado Abierto (COMA) y el Consejo de Administración de Valores del Tesoro General de la Nación (CAVT), a partir de la fecha las reuniones de estos Comités y la Subasta Electrónica de Valores se efectuarán con una frecuencia bisemanal. La próxima subasta de valores se realizará el día miércoles 21 de octubre de 2009.

ATENTAMENTE

SUBGERENCIA DE OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO