

TIPO DE CAMBIO

Fecha	Compra	Venta	Demanda 06/10/2004	Venta Efectiva 07/10/2004	UFV
7-oct-2004	7,99	8,01	3.000.000	3.000.000	1,07541

BOLSIN

I OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OPERACIONES DE REPORTO

i. Operaciones de Reporto vigentes

Moneda	F. Operación	T. Premio	Monto	Plazo	F. Venc.
MN	04/10/2004	6,03%	3.644.440,00	4	08-10-04
		TOTAL	3.644.440,00		

ii. Oferta diaria máxima de Reportos en Mesa de Dinero

Moneda	Saldo Diario Disponible	Tasa	TEA a)	Tasa	TEA a)	Plazo Máximo	Tasa de Valoración c)
		Subasta (*)	Subasta	Mesa b)	Mesa		
MN	20.000.000,00	6,00%	6,18%	6,50%	6,71%	15	11,00%
ME	5.000.000,00	7,50%	7,78%	8,00%	8,31%	15	16,00%

a) TEA calculada para un plazo de 15 días

(*) Vigentes desde el 7 de octubre al 13 de octubre de 2004

b) 50 puntos básicos sobre la tasa de subasta.

c) Tasa utilizada para determinar el valor de ida de una operación de reporto.

iii. Saldo vigente máximo para Reportos en Mesa de Dinero

Moneda	Saldo Semanal	Tasa	TEA a)	Tasa	TEA a)	Plazo Máximo
		Subasta (*)	Subasta	Mesa b)	Mesa	
MN	96.355.560,00	6,00%	6,18%	6,50%	6,71%	15
ME	25.000.000,00	7,50%	7,78%	8,00%	8,31%	15

a) TEA calculada para un plazo de 15 días.

(*) Vigentes desde el 7 de octubre al 13 de octubre de 2004

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	7,50%	7,78%	9,00%	9,40%
2do	8,20%	8,53%	9,60%	10,05%

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

a) TEA calculada para un plazo de 15 días

C. SUBASTA PÚBLICA DE VALORES PÚBLICOS Y SERVICIOS DE DEPÓSITOS BANCARIOS

i. Oferta para la subasta pública 42/2004 del miércoles 13/10/04

Título	Moneda	Plazo	Modalidad	Valor Nominal
LT	MN	91	Competitiva	3.000.000
LT	MN	182	Competitiva	6.000.000
LT	MN	364	Competitiva	20.000.000
LT	ME	91	Competitiva	3.000.000
LT	ME	364	Competitiva	1.000.000
BT 5,00%	ME	728	Competitiva	6.000.000
BT 5,50%	ME	1.456	Competitiva	2.000.000
BT 5,00%	MN-UFV (*)	728	Competitiva	15.000.000
BT 5,50%	MN-UFV (*)	1.456	Competitiva	10.000.000

(*) Títulos en Moneda Nacional indexados a la Unidad de Fomento de Vivienda (UFV).

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

No existe oferta de depósitos.

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

Tasa	Plazo
9,00%	7 días

II MERCADO MONETARIO

A. OPERACIONES INTERBANCARIAS MENORES A 30 DÍAS

(en miles)

Fecha al:	i) Moneda Nacional					ii) Moneda Extranjera				
	Min.	Max.	Prom.	Plazo	Monto	Min.	Max.	Prom.	Plazo	Monto
30-sep	1,50%	5,00%	2,14%	11	10.007	-	-	-	-	-
01-oct	-	-	-	-	-	1,00%	1,00%	1,00%	3	2.500
04-oct	-	-	-	-	-	1,50%	1,50%	1,50%	1	1.000
05-oct	2,00%	2,00%	2,00%	2	8.000	1,50%	1,50%	1,50%	1	1.000
06-oct	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

B. INTERBANCARIAS MAYORES O IGUALES A 30 DIAS E INSTITUCIONES NO BANCARIAS

(en miles)

Fecha: al	i) Moneda Nacional					ii) Moneda Extranjera					Monto
	Min.	Max.	Prom.	Plazo	Monto	Min.	Max.	Prom.	Plazo	Monto	
30-sep	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
01-oct	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
04-oct	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
05-oct	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
06-oct	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

III. INDICADORES MACROECONÓMICOS (En Millones)

Fecha	Emisión Bs.	Reservas \$us	Dep. (p) \$us	Encaje día (*) Excedente (Deficiencia)				Encaje Promedio (*) Excedente (Deficiencia)			
				EFECTIVO		TITULOS		EFECTIVO		TITULOS	
				MN	ME	MN	ME	MN	ME	MN	ME
30-sep	3.338,1	950,6	2.420,4	326,0	3,4	-4,9	1,7	207,7	12,2	-0,2	0,7
01-oct	3.361,5	965,4	2.382,1	184,6	-0,5	-9,2	1,1	184,6	-0,5	-9,2	1,1
04-oct	3.307,2	963,9	2.399,8	466,4	-3,7	-14,2	1,1	255,1	-1,3	-10,4	1,1
05-oct	3.392,1	958,5	2.414,0	524,3	-3,9	13,2	1,2	308,9	-1,8	-5,7	1,1
06-oct	3.467,9	964,0(p)	n.d.	589,3	1,3	13,2	1,2	355,6	-1,3	-2,6	1,1

(*) El encaje toma en cuenta los depósitos que eran del BBA y están en manos del BCR actualmente.

IV MERCADO INTERNACIONAL

A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO

Plazo semanas	EEUU	Arg ME	Chile \$	Méx MN(m)	Libor
	6-oct-04	05-oct-04	05-oct-04	6-oct-04	6-oct-04
4	1,50 ↑	-	2,16 ↑	7,74 ↑	1,840
13	1,67	-	2,36 ↓	8,03	2,045 ↑
26	1,98 ↑	-	-	8,28 ↓	2,216 ↑
51	-	-	-	8,61 ↑	2,510 ↑
Prime Rate (1)		4,75			
Fed Funds (1)		1,73 ↓			

(1) Tasas indicativas

(m) Mercado Secundario

B. TIPOS DE CAMBIO

TIPO DE CAMBIO (e) al 06-10-2004

Argentina	2,970 ↓	Japón	111,375 ↑
Reino Unido	0,563 ↑	México	11,292 ↑
Brasil	2,842 ↑	Perú	3,332 ↓
Chile	601,000 ↑	Unión Europea	0,814 ↑

(e) Respecto al dólar

IMPORTANTE

A todas las Entidades Financieras (Bancos, Mutuales, Agencias de Bolsa, Safis, Fondos y AFP's), reiteramos la invitación a la reunión de coordinación para las pruebas Operativa con Valores Públicos Desmaterializados, que se llevará a cabo en el piso 21 del Banco Central el día viernes 8 de octubre de 2004, a horas 9:00 a.m.

El Comité de Operaciones de Mercado Abierto (COMA) y el Consejo de Administración de Valores del Tesoro (CAVT), determinaron que a partir del 1° de octubre de 2004, el monto mínimo para participar en la subasta de títulos públicos es de \$us100.000

Asimismo, establecieron que cualquier solicitud de fraccionamiento podrá efectuarse hasta montos mínimos similares a los definidos para la subasta semanal, hasta el inicio del proceso de desmaterialización.

ATENTAMENTE

SUBGERENCIA DE OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

