

M&M DIARIO

Al:

13-dic-2004

TIPO DE CAMBIO

Fecha	Compra	Venta	Demanda 10/12/2004	Venta Efectiva 13/12/2004	UFV
13-dic-2004	8,03	8,05	0	0	1,08341

BOLSIN

I OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OFERTA DE TITULOS EN MESA DE DINERO

Título	Moneda	Plazo	Cantidad	TD	TEA	P U
LT	MN	179	9.000	6,9245%	7,3000%	965,57

Nota: El PU está calculado para el día viernes 10/12/2004 (*) Vigente del 10 al 14 de diciembre de 2004

B. OPERACIONES DE REPORTO

No existen operaciones de reporto vigentes

ii. Oferta diaria máxima de Reportos en Mesa de Dinero

Moneda	Saldo Diario Disponible	Tasa Subasta (*)	TEA a) Subasta	Tasa Mesa b)	TEA a) Mesa	Plazo Máximo	Tasa de Valoración c)
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

b) 50 puntos básicos sobre la tasa de subasta.

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

(*) Vigente desde el 9 al 15 de diciembre de 2004

iii. Saldo vigente máximo para Reportos en Mesa de Dinero

Moneda	Saldo Semanal	Tasa Subasta (*)	TEA a) Subasta	Tasa Mesa b)	TEA a) Mesa	Plazo Máximo
MN	100.000.000,00	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.

b) 50 puntos básicos sobre la tasa de subasta.

(*) Vigente desde el 9 al 15 de diciembre de 2004

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 51/2004 del miércoles 15/12/04

Título	Moneda	Plazo	Modalidad	Valor Nominal
LT	MN	91	Competitiva	5.000.000
LT	MN	182	Competitiva	15.000.000
LT	MN	364	Competitiva	30.000.000
LT	ME	364	Competitiva	1.000.000
BT 5,00%	ME	728	Competitiva	1.000.000
BT 5,50%	ME	1.456	Competitiva	2.000.000
BT 5,00%	MN-UFV (*)	728	Competitiva	10.000.000
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
06-dic	1,20%	1,20%	1,20%	1	14.000	0,75%	1,00%	0,81%	3	7.500
07-dic	1,50%	1,50%	1,50%	12	10.018	0,90%	1,20%	1,00%	3	7.800
08-dic	1,50%	1,50%	1,50%	1	3.000	0,75%	1,00%	0,91%	2	5.500
09-dic	1,50%	1,50%	1,50%	2	18.000	0,75%	1,20%	0,99%	3	6.700
10-dic	1,00%	1,80%	1,44%	5	20.048	0,75%	1,20%	1,01%	4	7.000

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	
06-dic	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
07-dic	1,50%	1,50%	1,50%	30	2.000	4,00%	4,50%	4,13%	201	700	-
08-dic	1,50%	1,50%	1,50%	30	2.000	-	-	-	-	-	-
09-dic	1,20%	1,20%	1,20%	32	4.000	-	-	-	-	-	-
10-dic	1,50%	1,50%	1,50%	32	2.004	2,00%	2,00%	2,00%	5	1.000	-

III. INDICADORES MACROECONÓMICOS (En Millones)

Fecha	Emisión	Reservas	Dep. (p)	Encaje día (*) Excedente (Deficiencia)				Encaje Promedio (*) Excedente (Deficiencia)			
				EFECTIVO		TITULOS		EFECTIVO		TITULOS	
				Bs.	\$us	MN	ME	MN	ME	MN	ME
06-dic	3.574,1	1.065,9	2.419,8	201,5	10,8	-3,5	-0,1	216,9	10,4	-4,2	0,4
07-dic	3.601,1	1.053,1	2.485,7	877,7	4,1	3,1	-0,4	272,0	9,8	-3,6	0,3
08-dic	3.789,5	1.049,0	2.507,4	728,3	4,9	3,2	-0,4	307,1	9,5	-3,0	0,3
09-dic	3.810,5	1.038,7(p)	2.513,3	674,2	2,6	3,2	-0,4	333,3	9,0	-2,6	0,2
10-dic	4.060,6	n.d.	n.d.	496,9	6,1	3,5	-0,1	496,9	6,1	3,5	-0,1

(*) 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
	10-dic-04	7-dic-04	7-dic-04	10-dic-04	10-dic-04
4	2,01 ↓	-	2,24	8,38	2,398 ↑
13	2,20 ↑	-	2,35	8,71	2,480 ↑
26 *	2,37 ↑	-	-	8,78 ↑	2,670 ↑
52 *	-	-	-	8,88 ↑	2,940 ↑
Prime Rate (1)		5,00			
Fed Funds (1)		2,05 ↑			

(1) Tasas indicativas

(m) Mercado Secundario

(e) Respecto al dólar

B. TIPOS DE CAMBIO

TIPO DE CAMBIO (e) al 10-12-2004

Argentina	2,976	Japón	105,140 ↑
Reino Unido	0,522 ↑	México	11,333 ↑
Brasil	2,776	Perú	3,293 ↓
Chile	592,400 ↓	Unión Europea	0,755 ↑

ATENTAMENTE

SUBGERENCIA DE OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO



