

M&M DIARIO

Al:

26-oct-2004

TIPO DE CAMBIO

Fecha	Compra	Venta	Demanda 25/10/2004	Venta Efectiva 26/10/2004	UFV
26-oct-2004	8,00	8,02	0	0	1,07771

BOLSIN

I OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OPERACIONES DE REPORTO

i. Operaciones de Reporto vigentes

Mon	F. Operación	T. Premio	Monto	Plazo	F. Venc.
MN	19-oct-2004	6,00%	4.645.400,00	7	26-10-04
		TOTAL	4.645.400,00		

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.

(*) Vigentes desde el 21 al 27 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 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.

(*) Vigentes desde el 21 al 27 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 44/2004 del miércoles 27/10/04

Título	Moneda	Plazo	Modalidad	Valor Nominal
LT	MN	91	Competitiva	3.000.000
LT	MN	182	Competitiva	6.000.000
LT	MN	364	Competitiva	15.000.000
LT	ME	91	Competitiva	1.000.000
LT	ME	364	Competitiva	1.000.000
BT 5,00%	ME	728	Competitiva	4.000.000
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)

i) Moneda Nacional

Fecha al:	Min.	Max.	Prom.	Plazo	Monto
19-oct	1,50%	3,00%	1,91%	4	12.500
20-oct	4,00%	4,00%	4,00%	5	4.000
21-oct	4,00%	4,00%	4,00%	5	5.000
22-oct	4,00%	4,00%	4,00%	4	15.000
25-oct	1,50%	4,00%	1,97%	5	12.000

ii) Moneda Extranjera

Min.	Max.	Prom.	Plazo	Monto
2,00%	2,50%	2,11%	5	2.500
-	-	-	-	-
1,50%	1,50%	1,50%	7	1.900
1,80%	1,80%	1,80%	5	1.500
1,50%	1,50%	1,50%	7	700

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

(en miles)

i) Moneda Nacional

Fecha: al	Min.	Max.	Prom.	Plazo	Monto
19-oct	-	-	-	-	-
20-oct	-	-	-	-	-
21-oct	1,50%	1,60%	1,54%	45	12.030
22-oct	8,40%	8,40%	8,40%	326	440
25-oct	5,50%	5,50%	5,50%	30	10.000

ii) Moneda Extranjera

Min.	Max.	Prom.	Plazo	Monto	Monto
-	-	-	-	-	-
4,50%	4,50%	4,50%	181	405	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-

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
19-oct	3.517,6	967,3	2.374,4	188,6	11,9	1,7	0,4	310,2	8,6	0,3	0,7
20-oct	3.471,7	976,3	2.391,9	195,2	17,4	1,8	0,4	291,1	10,1	0,6	0,7
21-oct	3.444,6	982,3	2.397,4	229,5	18,4	1,8	0,4	282,3	11,3	0,7	0,6
22-oct	3.424,9	980,8	2.394,5	234,6	14,3	14,8	1,2	276,3	11,7	2,5	0,7
25-oct	3.401,2	982,6(p)	nd	210,3	9,3	10,8	-0,5	262,7	11,9	5,5	0,7

(*) 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
	25-oct-04	19-oct-04	19-oct-04	25-oct-04	25-oct-04
4	1,60 ↑	-	2,06	7,94 ↑	1,951 ↑
13	1,83 ↑	-	2,29	8,17 ↑	2,110
26	2,02 ↑	4,69	-	8,48 ↑	2,225 ↓
52	-	6,05	-	8,59 ↑	2,420 ↓
Prime Rate (1)		4,75			
Fed Funds (1)		1,72 ↓			

(1) Tasas indicativas

(m) Mercado Secundario

B. TIPOS DE CAMBIO

TIPO DE CAMBIO (e) al 25-10-2004

Argentina	2,969 ↑	Japón	106,740 ↓
Reino Unido	0,543 ↓	México	11,539 ↑
Brasil	2,883 ↑	Perú	3,311
Chile	614,250 ↑	Unión Europea	0,781 ↓

(e) Respecto al dólar

ATENTAMENTE

SUBGERENCIA DE OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO



