

M&M DIARIO

AI:

29-sep-2004

TIPO DE CAMBIO

BOLSIN

Fecha	Compra	Venta
29-sep-2004	7,98	8,00

Demanda 28/09/2004	Venta Efectiva 29/09/2004
0	0

UFV
1,07439

I OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OPERACIONES DE REPORTO

i. Operaciones de Reporto vigentes

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.

(*) Vigentes desde el 23 al 29 de septiembre 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.

(*) Vigentes desde el 23 al 29 de septiembre 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 40/2004 del miércoles 29/09/04

Título	Moneda	Plazo	Modalidad	Valor Nominal
LT	MN	91	Competitiva	3.000.000
LT	MN	182	Competitiva	6.000.000
LT	MN	364	Competitiva	25.000.000
LT	ME	91	Competitiva	5.000.000
LT	ME	364	Competitiva	3.000.000
BT 5,00%	ME	728	Competitiva	6.000.000
BT 5,50%	ME	1.456	Competitiva	3.000.000
BT 5,00%	MN-UFV (*)	728	Competitiva	15.000.000
BT 5,50%	MN-UFV (*)	1.456	Competitiva	5.000.000
BT 6,00%	MN-UFV (*)	3.276	Competitiva	25.000.000

(*) 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)						(en miles)					
i) Moneda Nacional						ii) Moneda Extranjera					
Fecha al:	Min.	Max.	Prom.	Plazo	Monto	Min.	Max.	Prom.	Plazo	Monto	
22-sep	1,50%	1,50%	1,50%	16	2.000	1,30%	1,50%	1,44%	4	2.000	
23-sep	1,50%	5,00%	2,19%	13	13.502	1,40%	1,50%	1,43%	5	3.500	
24-sep	1,50%	1,50%	1,50%	13	3.500	1,50%	1,50%	1,50%	3	500	
27-sep	1,50%	1,50%	1,50%	16	6.797	1,00%	1,50%	1,17%	3	3.000	
28-sep	1,50%	1,50%	1,50%	16	4.006	2,00%	2,00%	2,00%	7	500	

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

(en miles)											
i) Moneda Nacional						ii) Moneda Extranjera					
Fecha: al	Min.	Max.	Prom.	Plazo	Monto	Min.	Max.	Prom.	Plazo	Monto	Monto
22-sep	5,20%	5,20%	5,20%	30	440	-	-	-	-	-	-
23-sep	2,00%	2,00%	2,00%	5	5.000	-	-	-	-	-	-
24-sep	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
27-sep	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
28-sep	-	-	-	-	-	3,00%	3,00%	3,00%	90	100	-

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
22-sep	3.423,1	887,4	2.412,6	200,8	21,5	3,9	0,3	174,6	21,4	1,0	1,3
23-sep	3.419,4	886,7	2.402,2	212,9	18,5	4,0	0,3	180,1	21,0	1,5	1,1
24-sep	3.407,0	890,7	2.394,4	210,4	6,1	1,5	-0,8	183,9	19,1	1,5	0,9
27-sep	3.385,6	885,9	2.405,6	191,4	0,5	-2,4	-1,2	189,4	15,1	1,1	0,4
28-sep	3.344,0	885,8 (p)	n.d.	234,4	-0,8	-4,9	1,6	193,1	13,8	0,6	0,5

(*) 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
	28-sep-04	28-sep-04	23-Sep-04	28-sep-04	28-sep-04
4	1,55 ↑	-	2,06	7,63 ↓	1,840
13	1,68	-	2,46 ↑	7,88 ↓	1,975 ↑
26	1,94	-	-	8,24 ↑	2,170
51	-	-	-	8,49 ↓	2,440 ↓
Prime Rate (1)		4,75			
Fed Funds (1)		1,76			

(1) Tasas indicativas

(m) Mercado Secundario

B. TIPOS DE CAMBIO

TIPO DE CAMBIO (e) al 28-09-2004

Argentina	2,988 ↓	Japón	111,400 ↑
Reino Unido	0,552 ↓	México	11,426
Brasil	2,866 ↓	Perú	3,347 ↓
Chile	605,250 ↓	Unión Europea	0,812 ↓

(e) Respecto al dólar

IMPORTANTE

Comunicamos a los agentes del Sistema Financiero que por decisión del COMA la tasa premio de reporto en M/N disminuye de 6,50% a 6,00%, tasa vigente a partir del 23-09-04. Asimismo la tasa de valoración también disminuye de 11,50% a 11,00%.

ATENTAMENTE

SUBGERENCIA DE OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

