



Al: 24-Oct-2011

M&M DIARIO

| TIPO DE CAMBIO | | |
|----------------|--------|-------|
| Fecha | Compra | Venta |
| 24-Oct-2011 | 6.87 | 6.97 |

| BOLSIN | | |
|---------|-------------|----------------------------|
| Demanda | 21-Oct-2011 | Venta Efectiva 24-Oct-2011 |
| - | - | - |

| UFV |
|---------|
| 1.69091 |

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OPERACIONES DE REPORTE

i. Operaciones de Reporto 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 20/10/2011 al 26/10/2011

| 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 | 5.00% | 5.12% | 5.50% | 5.65% | 15 | 10.00% |
| ME | 5,000,000.00 | 8.75% | 9.13% | 9.25% | 9.67% | 15 | 17.25% |

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

b) 99 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 8%

iii. Saldo vigente máximo para Reportos

(*) Vigente del 20/10/2011 al 26/10/2011

| Moneda | Saldo Semanal | Tasa Subasta (*) | TEA a) Subasta | Tasa Mesa b) | TEA a) Mesa | Plazo Máximo |
|--------|----------------|------------------|----------------|--------------|-------------|--------------|
| MN | 125,000,000.00 | 5.00% | 5.12% | 5.50% | 5.65% | 15 |
| ME | 25,000,000.00 | 8.75% | 9.13% | 9.25% | 9.67% | 15 |

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

b) 99 puntos básicos sobre la tasa de subasta.

iv. Créditos con garantía en el Fondo RAL

| Tramos | MN | TEA a) | ME | TEA a) |
|--------|-------|--------|--------|--------|
| 1er | 6.50% | 6.71% | 10.25% | 10.78% |
| 2do | 7.00% | 7.25% | 10.75% | 11.34% |

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

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 de la semana 43/2011

Miércoles 26/10/11 Apertura: Hrs. 9:00 am.

| Valor | Emisor | Cierre | Moneda | Plazo | Modalidad | Cantidad |
|-------------|--------|--------|------------|--------|-------------|----------|
| LT-MU | BCB | 09:10 | MN-UFV (*) | 364 | Competitiva | 1,000 |
| LT-MN | BCB | 09:20 | MN | 91 | Competitiva | 25,000 |
| LT-MN | BCB | 09:30 | MN | 182 | Competitiva | 130,000 |
| LT-MN | BCB | 09:40 | MN | 273 | Competitiva | 130,000 |
| LT-MN | BCB | 09:50 | MN | 364 | Competitiva | 90,000 |
| BT-MN 2,00% | BCB | 10:00 | MN | 728 | Competitiva | 90,000 |
| BT-MN 2,50% | TGN | 10:10 | MN | 1,456 | Competitiva | 1,000 |
| BT-MN 2,80% | TGN | 10:20 | MN | 2,184 | Competitiva | 1,000 |
| BT-MN 3,00% | TGN | 10:30 | MN | 2,912 | Competitiva | 2,000 |
| BT-MN 3,20% | TGN | 10:40 | MN | 3,640 | Competitiva | 5,000 |
| BT-MN 3,60% | TGN | 10:50 | MN | 5,460 | Competitiva | 10,000 |
| BT-MN 3,80% | TGN | 11:00 | MN | 7,280 | Competitiva | 30,000 |
| BT-MN 4,00% | TGN | 11:10 | MN | 10,920 | Competitiva | 200,000 |

(*) 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 para SRD-ME

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)

| i) Moneda Nacional | | | | | | ii) Moneda Extranjera | | | | |
|--------------------|------|------|-------|-------------|-------|-----------------------|------|-------|-------------|-------|
| Fecha al: | Min. | Max. | Prom. | Plazo Prom. | Monto | Min. | Max. | Prom. | Plazo Prom. | Monto |
| 17-Oct | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 18-Oct | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 19-Oct | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 20-Oct | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 21-Oct | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

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

| i) Moneda Nacional | | | | | | ii) Moneda Extranjera | | | | |
|--------------------|-------|-------|-------|-------------|--------|-----------------------|------|-------|-------------|-------|
| Fecha al: | Min. | Max. | Prom. | Plazo Prom. | Monto | Min. | Max. | Prom. | Plazo Prom. | Monto |
| 17-Oct | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 18-Oct | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 19-Oct | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 20-Oct | 2.50% | 2.50% | 2.50% | 15 | 20,000 | - | - | - | - | - |
| 21-Oct | 2.50% | 2.50% | 2.50% | 17 | 10,000 | - | - | - | - | - |

III. INDICADORES MACROECONOMICOS (En Millones)

| Fecha al: | Emisión (*) | Reservas (*) | Dep. Banc. | Dep. No Banc. |
|-----------|-------------|---------------|------------|---------------|
| | Bs. | Sus | Sus | Sus |
| 17-Oct | 26,042.94 | 11,745.01 | 8,137.50 | 1,720.30 |
| 18-Oct | 26,039.89 | 11,706.44 | 8,154.69 | 1,717.69 |
| 19-Oct | 26,071.71 | 11,691.30 | 8,179.43 | 1,718.38 |
| 20-Oct | 26,095.50 | 11,668.75 | 8,156.20 | 1,720.37 |
| 21-Oct | 26,058.21 | 11,647.52 (p) | nd. | nd. |

(n.d.) No disponible
(p) Dato preliminar
(*) y (p) promedios de octubre 1 y 2010/2011, en millones y referidos al mes anterior con los decimales.

| 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 |
| 17-Oct | 3837.22 | 168.91 | 8.67 | 0.68 | -1.37 | 0.06 | 3929.25 | 179.18 | 8.69 | -9.71 | -0.04 | 0.01 |
| 18-Oct | 3301.44 | 170.11 | 8.76 | 28.61 | -1.28 | -0.14 | 3850.77 | 178.05 | 8.70 | -4.92 | -0.20 | -0.01 |
| 19-Oct | 3268.89 | 171.61 | 8.72 | 18.38 | -2.53 | -0.11 | 3786.12 | 177.33 | 8.70 | -2.33 | -0.46 | -0.02 |
| 20-Oct | 3077.57 | 170.33 | 8.72 | -10.38 | -7.30 | -0.09 | 3715.26 | 176.63 | 8.70 | -3.14 | -1.14 | -0.03 |
| 21-Oct | 2885.73 | 167.63 | 8.73 | -11.81 | -3.71 | -0.05 | 3639.85 | 175.81 | 8.70 | -3.92 | -1.38 | -0.03 |

(p) datos preliminares.

IV MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

| A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO | | | | | | B. TIPOS DE CAMBIO | | | | | |
|-------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|----------------------------------|---------|---|---------------|--------|---|
| Plazo semanas | EEUU | Arg \$ | Chile \$ | Méx MN(m) | Libor | TIPO DE CAMBIO (c) al 21/10/2011 | | | | | |
| | 21-Oct-11 | 18-Oct-11 | 18-Oct-11 | 21-Oct-11 | 21-Oct-11 | | | | | | |
| 4 | 0.00 | - | - | - | 0.245 | Argentina | 4.235 | ↑ | Japón | 76.166 | ↓ |
| 13 | 0.02 | ↑ | - | - | 0.418 | Reino Unido | 0.627 | ↓ | México | 13.690 | ↓ |
| 26 | 0.05 | 14.00 | - | 3.82 | 0.607 | Brasil | 1.779 | ↓ | Perú | 2.721 | ↓ |
| 36 | - | - | - | - | - | Chile | 513.150 | ↓ | Unión Europea | 0.7210 | ↓ |
| 52 | - | - | - | - | 0.921 | | | | | | |
| 104 | - | 15.05 | - | - | - | | | | | | |
| Prime Rate | | 3.25 | | | | | | | | | |
| Fed Funds | | 0.07 | | | | | | | | | |

(m) Menado Secundario

(c) Respecto al dólar

ATENTAMENTE

LA SUBGERENCIA DE OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO DEL BANCO CENTRAL DE BOLIVIA