Gerencia de Operaciones Monetarias
Subgerencia de Operaciones de Mercado Abierto
Departamento de Análisis y Control de Operaciones de Mercado Abierto

Información del 17-10-2023 al 18-10-2023

OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

TIPO DE CAMBIO		
Fecha	Compra	Venta
18/10/2023	6,86	6,96

UFV
2,46356

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

No existe oferta

B. OPERACIONES DE REPORTO

i. Reportos Vigentes al 17/10/2023

Moneda	Saldo al	T. Premio Prom.	Monto	Plazo Prom. (días)
MN	17/10/2023	5,50%	274.599.400,00	43
		Total Vigente	274.599.400,00	

ii. Vencimientos Reportos de 18/10/2023

Moneda	F. de Reporto	T. Premio	Monto Inicial	Plazo (días)
MN	05/09/2023	5,50	18.753.500,00	43
MN	10/10/2023	5,50	1.423.000,00	8

iii. Oferta diaria de Reportos vigente del 12/10/2023 al 18/10/2023

Para Valores Públicos y Valores de Emisores Privados (DPF MN)

Moneda	Monto Diario Disponible desde 13-07-23	Tasa Subasta (c)	TEA (d) Subasta	Tasa Mesa (e)	TEA (d) Mesa	Plazo Máximo (días)	Tasa de Valoración (f)
MN	200.000.000	5,50%	5,63%	6,00%	6,16%	45	10,50%
ME (g)	2.000.000	6,00%	6,18%	6,50%	6,71%	15	14,50%

c) Tasa vigente del 12/10/2023 al 18/10/2023.

d) TEA referencial calculada para un plazo de 45 días (MN) y 15 días (ME).

e) 50 puntos básicos sobre la tasa premio más alta adjudicada en subasta.

f) Tasa para determinar el Valor de Ida en una operación de reporto con valores públicos. Para MN con valores de emisores privados: DPF AAA (12,00%), DPF AA1 (12,50%), DPF AA2 (13,20%), DPF AA3 (14,10%) y DPF A1(15,20%).

g) Operaciones con valores públicos en ME.

iv. Tasas para Créditos con garantía del Fondo RAL (g)

Tramos	MN	TEA (h)	ME	TEA (h)
1er	5,70%	5,86%	8,00%	8,32%
2do	6,00%	6,18%	8,50%	8,86%

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

h) TEA calculada para un plazo de 7 días.

C. OFERTA DE VALORES EN SUBASTA

i. Subasta Electrónica de Valores Públicos de la semana 42/2023

Miércoles 18/10/2023 Apertura: Hrs. 9:00 am.

Valor	Emisor	Cierre	Periodo de protección (i)	Moneda	Plazo (días)	Modalidad	Cantidad (j)
LB-MN	BCB	09:10	-	MN	28	Competitiva	5.000
LB-MN	BCB	09:20	-	MN	63	Competitiva	5.000
LB-MN	BCB	09:30	-	MN	91	Competitiva	5.000
LB-MN	BCB	09:40	-	MN	182	Competitiva	10.000
LR-MN	BCB	09:50	91	MN	273	Competitiva	250.000
LR-MN	BCB	10:00	91	MN	364	Competitiva	250.000
BR-MU 0,80%	BCB	09:10	91	UFV	546	Competitiva	20.000
BR-MU 1,20%	BCB	09:20	91	UFV	728	Competitiva	40.000
BT-MN 4,80%	TGN	09:10	-	MN	3.640	Competitiva	150.000
BT-MN 5,00%	TGN	09:20	-	MN	5.460	Competitiva	300.000
BT-MN 5,23%	TGN	09:30	-	MN	7.280	Competitiva	150.000
BT-MN 5,44%	TGN	09:40	-	MN	10.920	Competitiva	50.000
BT-MN 5,55%	TGN	09:50	-	MN	18.200	Competitiva	50.000

(i) En días, corresponde a los títulos con opción de rescate anticipado.

(j) Cada título tiene un valor nominal de 1.000 unidades en moneda origen.

II. MERCADO MONETARIO

OPERACIONES INTERBANCARIAS DEL SISTEMA BANCARIO (*)
(en miles)

Fecha al:	i) Moneda Nacional					ii) Moneda Extranjera				
	Mín.	Máx.	Prom. (**)	Plazo Prom.	Monto	Mín.	Máx.	Prom. (**)	Plazo Prom.	Monto
11-oct	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
12-oct	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
13-oct	8,00%	8,00%	8,00%	28	4.600	-	-	-	-	-
16-oct	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
17-oct	8,00%	8,00%	8,00%	28	3.800	-	-	-	-	-

Operaciones interbancarias realizadas por sondeo. Datos Preliminares.
(*) Incluye operaciones de Entidades Financieras de Vivienda entre otras (IFD).
(**) Promedio Ponderado por monto.

III. OPERACIONES DE REPORTO REALIZADAS EN LA BOLSA BOLIVIANA DE VALORES 17/10/2023

Instrumentos	Monto negociado (en dólares americanos)
Bonos Bancarios Bursátiles	14.542,07
Bonos del Banco Central de Bolivia	
Bonos de Largo Plazo	280.375,63
Bonos BCB Prepagables	
Bonos Municipales	
Bonos del Tesoro	
Cupones de Bonos	
Letras del Tesoro	
Depósitos a Plazo Fijo	4.178.162,27
Letras del Banco Central de Bolivia	
Letras BCB Prepagables	
Pagarés Bursátiles	19.056,33
Valores de Contenido Crediticio	
Total	**4.492.136,30**

Fuente: BBV

Moneda	Instrumentos	Emisores	Tasas de rendimiento según rango de plazo en días					
			1 - 7	8 - 15	16 - 22	23 - 30	31 - 37	38 - 45
BS	DPF	BEC	3,00%				3,00%	
		BGA	5,00%			4,00%		
		BME						4,00%
		BSO					3,00%	4,00%
		BUN				3,00%		
		FEF				3,00%		
		FFO				3,00%		
		FIE				3,00%		
		NFB			4,00%			4,00%
	BBB	BUN				3,00%		
	BLP	NUT					3,00%	
		SOF					3,00%	3,00%
	PGB	NUT						3,00%

Fuente: BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 17/10/2023

Mercado Bursátil					
	Prom. Ponderado			Tasas	
Moneda	CVT	Reporto	General	Min	Max
Plazos Hasta 45 Días					
MN		3,49%	3,49%	3,00%	5,00%
MU					
ME	0,90%		0,90%	0,90%	0,90%
MY					
MV					

Fuente: BBV

V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO

Plazo	EEUU		Chile $		Méx MN(j)		Libor ($us)	
semanas	17-oct.-2023	Var. (%) Diaria	17-oct.-2023	Var. (%) Diaria	17-oct.-2023	Var. (%) Diaria	17-oct.-2023	Var. (%) Diaria
4	5,41 ↓	-(0,01%)	9,10 ↓	-(0,15%)	10,95 ↓	-(0,10%)	5,45 →	(0,00%)
13	5,34 ↑	(0,02%)	-		11,40 →	(0,00%)	5,66 →	(0,00%)
26	5,34 ↑	(0,04%)	-		11,70 ↑	(0,18%)	5,88 →	(0,00%)
52	-		-		11,75 ↑	(0,02%)	6,04 →	(0,00%)
Prime Rate	**8,50**	→ **(0,00%)**						
Fed Funds	**5,33**	→ **(0,00%)**						

(j) Mercado Primario

B. TIPOS DE CAMBIO

Tipo de Cambio (l) al 17-oct.-2023				
		Var. (%) Diaria		Var. (%) Diaria
Argentina	350,01 ↓	-(0,06%)	México	18,01 ↑ (0,11%)
Brasil	5,04 →	(0,00%)	Uruguay	39,85 ↑ (0,01%)
Chile	937,67 ↓	-(8,66%)	Reino Unido	0,82 → (0,00%)
Perú	3,85 ↓	-(0,01%)	Unión Europea	0,95 → (0,00%)

(l) Respecto al dólar