

OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

TIPO DE CAMBIO			UFV
Fecha	Compra	Venta	
29/9/2023	6,86	6,96	2,45983

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

i. Oferta de Valores en Mesa de Dinero vigente del 29/09/2023 al 03/10/2023

Valor	Moneda	Plazo en días	Período de protección (a)	Cantidad de valores remanente (b)	TR (%)
LR	MN	273	91	150.000	3,3997
LR	MN	364	91	37.000	3,4991
BT 4,80%	MN	3.640	-	100.000	4,8000
BT 5,00%	MN	5.460	-	50.000	5,0000

a) En días, corresponde a los títulos con opción de rescate anticipado. El período de protección se contabiliza a partir de la fecha de emisión de los valores rescatables. Cuando la colocación de estos valores se realice en días posteriores a la fecha de emisión, a través de Mesa de Dinero, el período de protección se ajustará según el plazo restante que corresponda.

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

B. OPERACIONES DE REPORTE

i. Reportos Vigentes al 28/09/2023

Moneda	Saldo al	T. Premio Prom.	Monto	Plazo Prom. en días
MN	28/09/2023	5,50%	349.362.262,92	44
Total Vigente			349.362.262,92	

ii. Vencimientos Reportos de 29/09/2023

Moneda	F. de Reporto	T. Premio	Monto Inicial	Plazo en días
MN	31/07/2023	5,50	1.765.000,00	60
MN	02/08/2023	5,50	3.258.996,94	58
MN	10/08/2023	5,50	1.060.000,00	50

iii. Oferta diaria de Reportos vigente del 28/09/2023 al 04/10/2023

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

Moneda	Monto Diario Disponible desde 13-07-23	Tasa Subasta (e)	TEA (d) Subasta	Tasa Mesa (c)	TEA (d) Mesa	Plazo (En días) Máximo	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 28/09/2023 al 04/10/2023.

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 reporte 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 40/2023

Miércoles 04/10/2023 Apertura: Hrs. 9:00 am.

Valor	Emisor	Cierre	Período de protección (i)	Moneda	Plazo (En 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 0,60%	BCB	09:10	91	UFV	546	Competitiva	10.000
BR-MU 1,00%	BCB	09:20	91	UFV	728	Competitiva	20.000
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
22-sep	6,00%	6,00%	6,00%	18	7.500	-	-	-	-	-
25-sep	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26-sep	8,50%	8,50%	8,50%	10	3.430	-	-	-	-	-
27-sep	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
28-sep	6,00%	6,00%	6,00%	21	3.700	-	-	-	-	-

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 28/09/2023

Instrumentos	Monto negociado (en dólares americanos)
Bonos Bancarios Bursátiles	310.276,97
Bonos del Banco Central de Bolivia	
Bonos de Largo Plazo	279.516,34
Bonos BCB Prepagables	
Bonos Municipales	
Bonos del Tesoro	
Cupones de Bonos	
Letras del Tesoro	
Depósitos a Plazo Fijo	15.779.168,91
Letras del Banco Central de Bolivia	
Letras BCB Prepagables	64.005,18
Pagarés Bursátiles	18.996,99
Valores de Contenido Crediticio	
Total	16.451.964,39

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	BGA						4,00%
		BIS	4,10%					3,00%
		BME			3,00%			3,00%
		BNB				3,93%		
		BSO				4,00%		3,00%
		BTB						4,47%
		BUN		1,00%				
		FEF		3,00%			3,00%	3,00%
		FFO						3,00%
		FIE						3,00%
		FPR						3,00%
		NFB	3,00%					
		BBB			4,00%			4,50%
		NUT				3,00%		
		BLP				3,00%		
LRS			4,10%					
PGB					3,00%			

Fuente: BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 28/09/2023

Mercado Bursátil					
Moneda	CVT	Prom. Ponderado		Tasas	
		Reporto	General	Mín	Max
Plazos Hasta 45 Días					
MN	3,00%	2,73%	2,75%	1,00%	6,00%
MU					
ME					
MY					
MV					

Fuente: BBV

V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

Plazo semanas	A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO							
	EEUU		Chile \$		Méx MN(j)		Libor (\$us)	
	28-sep.-2023	Var. (%) Diaria	26-sep.-2023	Var. (%) Diaria	28-sep.-2023	Var. (%) Diaria	28-sep.-2023	Var. (%) Diaria
4	5,39 ↓	-(0,01%)	9,50 ⇒	(0,00%)	11,05 ⇒	(0,00%)	5,43 ⇒	(0,00%)
13	5,30 ↓	-(0,03%)	-		11,39 ⇒	(0,00%)	5,66 ↑	(0,01%)
26	5,30 ↓	-(0,02%)	8,41 ⇒	(0,00%)	11,60 ⇒	(0,00%)	5,90 ⇒	(0,00%)
52	-		-		11,66 ⇒	(0,00%)	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 28-sep.-2023					
	Var. (%) Diaria			Var. (%) Diaria	
Argentina	350,02 ↑	(0,04%)	México	17,60 ↓	-(0,08%)
Brasil	5,04 ↓	-(0,01%)	Uruguay	38,39 ↑	(0,05%)
Chile	907,18 ↓	-(4,57%)	Reino Unido	0,82 ⇒	(0,00%)
Perú	3,80 ↓	-(0,01%)	Unión Europea	0,95 ⇒	(0,00%)

(l) Respecto al dólar