





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

Información del 20-02-2024 al 21-02-2024

OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

TIPO DE CAMBIO					
Fecha	Compra	Venta			
21/2/2024	6,86	6,96			

UFV 2,48141

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

B. OPERACIONES DE REPORTO

i. Reportos Vigentes al 20/02/2024

Moneda	Saldo al	T. Premio Prom.	Monto	Plazo Prom. (días)
MN	20/02/2024	5,50%	147.218.000,00	41
		Total Vigente	147 218 000 00	

ii. Vencimientos Reportos de 21/02/2024

Moneda	F. de Reporto	T. Premio	Monto Inicial	Plazo (días)
MN	19/01/2024	5,50	4.675.000,00	33
MN	30/01/2024	5,50	3.882.000,00	22

iii. Oferta diaria de Reportos vigente del 15/02/2024 al 21/02/2024

Para Valores Públicos y Valores de Emisores Privados (DPF y Bonos Verdes en 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 15/02/2024 al 21/02/2024.

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 08/2024

	Miércoles 21/02/2024 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	50.000		
LB-MN	BCB	09:20		MN	63	Competitiva	100.000		
LB-MN	BCB	09:30	-	MN	91	Competitiva	100.000		
LB-MN	BCB	09:40		MN	182	Competitiva	100.000		
LR-MN	BCB	09:50	91	MN	273	Competitiva	500.000		
LR-MN	BCB	10:00	91	MN	364	Competitiva	500.000		
BR-MU 0,85%	BCB	09:10	91	UFV	546	Competitiva	20.000		
BR-MU 1,40%	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.

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.

⁾ Tasa para determinar el Valor de la 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%), DPF AI1(15,20%) y Bonos Verdes AAA (10,25%)

g) Operaciones con valores públicos en ME.

II. MERCADO MONETARIO

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

		i) M	oneda Nacional			ii) Moneda Extranjera				
Fecha al:	Mín.	Máx.	Prom. (**)	Plazo Prom.	Monto	Mín.	Máx.	Prom. (**)	Plazo Prom.	Monto
14-feb	-		-	-	-	-	-		-	-
15-feb	4,50%	6,00%	4,90%	16	5.172	-	-	-	-	-
16-feb	8,00%	8,00%	8,00%	10	6.000	-	-			-
19-feb	6,50%	6,50%	6,50%	28	14.000	-				
20-feb					-	-				

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 $\, 20/02/2024$

Instrumentos	Monto negociado (en dólares americanos)
Bonos Bancarios Bursátiles	17.492,71
Bonos del Banco Central de Bolivia	
Bonos de Largo Plazo	324.000,00
Bonos BCB Prepagables	
Bonos Municipales	
Bonos del Tesoro	
Cupones de Bonos	
Letras del Tesoro	
Depósitos a Plazo Fijo	3.217.201,17
Letras del Banco Central de Bolivia	
Letras BCB Prepagables	70.088,92
Pagarés Bursátiles	
Valores de Contenido Crediticio	
Total	3.628.782,80

Tasas de rendimiento según rango de plazo en días Instrumentos 16 - 22 38 - 45 4,20% BSO FFO FIE FPR BUN BCB TSM 3,10% DPF 4,00% 3,00% 3,00% 5,00% BBB 3.00% LRS 3,00% USD ente: BBV BLP 1,00%

Fuente: BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 20/02/2024

	Prom. Ponderado				
Moneda	CVT	Reporto	General	Min	Max
lazos Hasta 45 Días					
MN	3,00%	3,66%	3,60%	3,00%	5,00%
MU					
ME					
MY					
MV					

Fuente: BBV

V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO							
Plazo	EEUU	Chile \$	Méx MN _(j)	Libor (\$us)			
semanas	20-feb2024 Var. (%) Diaria	15-feb2024 Var. (%) Diaria	20-feb2024 Var. (%) Diaria	20-feb2024 Var. (%) Diaria			
4	5,39 (0,00%)	7,19 🖈 (0,00%)	11,00 -(0,05%)	5,43 (0,00%)			
13	5,22 (0,00%)		11,35 🁚 (0,01%)	5,59 1 (0,01%)			
26	5,10 🖤 -(0,01%)		11,33 -(0,02%)	5,69 1 (0,03%)			
52	-		11,22 -(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 20-feb2024							
	Var. (%) Diaria Var. (%) Diaria						
Argentina	837,30 1 (0,55%)	México	17,07 🁚	(0,03%)			
Brasil	4,93 🌗 -(0,03%)	Uruguay	39,05 🖐	-(0,04%)			
Chile	962,81 -(3,50%)	Reino Unido	0,79 🖈	(0,00%)			
Perú	3,78 🌗 -(0,02%)	Unión Europea	0,93 🖈	(0,00%)			

(l) Respecto al dólar