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

**Información del 21-02-2024 al 22-02-2024**

# OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

| TIPO DE CAMBIO | | |
|---|---|---|
| Fecha | Compra | Venta |
| 22/2/2024 | 6,86 | 6,96 |

| UFV |
|---|
| 2,48154 |

## I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

### A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

**i. Oferta de Valores en Mesa de Dinero vigente del 23/02/2024 al 27/02/2024**

| Valor | Emisor | Plazo (días) | Periodo de protección (a) | Cantidad de valores disponible (b) | TR (%) |
|---|---|---|---|---|---|
| LB-MN | BCB | 28 | - | 50.000 | 0,2500 |
| LB-MN | BCB | 63 | - | 100.000 | 0,7500 |
| LB-MN | BCB | 91 | - | 100.000 | 1,0000 |
| LB-MN | BCB | 182 | - | 100.000 | 2,7500 |
| LR-MN | BCB | 273 | 91 | 500.000 | 3,8800 |
| LR-MN | BCB | 364 | 91 | 500.000 | 4,2000 |
| BR-MU 0,85% | BCB | 546 | 91 | 20.000 | 0,8500 |
| BR-MU 1,40% | BCB | 728 | 91 | 40.000 | 1,4000 |
| BT-MN 4,80% | TGN | 3.640 | - | 200.000 | 4,8000 |

a) En días, corresponde a los títulos con opción de rescate anticipado. El periodo 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 periodo 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 REPORTO

**i. Reportos Vigentes al 21/02/2024**

| Moneda | Saldo al | T. Premio Prom. | Monto | Plazo Prom. (días) |
|---|---|---|---|---|
| MN | 21/02/2024 | 5,50% | 142.571.000,00 | 42 |
| | | **Total Vigente** | 142.571.000,00 | |

**ii. Vencimientos Reportos de 22/02/2024**

| Moneda | F. de Reporto | T. Premio | Monto Inicial | Plazo (días) |
|---|---|---|---|---|
| MN | 08/01/2024 | 5,50 | 4.311.000,00 | 45 |
| MN | 10/01/2024 | 5,50 | 10.046.000,00 | 43 |

**iii. Oferta diaria de Reportos vigente del 22/02/2024 al 28/02/2024**

**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 22/02/2024 al 28/02/2024.

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%), DPF A1(15,20%) y Bonos Verdes AAA (10,25%)

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 09/2024**

**Miércoles 28/02/2024 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.

## 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 |
| 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 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 21-feb | 6,00% | 6,00% | 6,00% | 28 | 11.662 | - | - | - | - | - |

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 21/02/2024

| Instrumentos | Monto negociado (en dólares americanos) |
|---|---|
| Bonos Bancarios Bursátiles | 1.101.804,38 |
| Bonos del Banco Central de Bolivia | |
| Bonos de Largo Plazo | 803.148,23 |
| Bonos BCB Prepagables | |
| Bonos Municipales | |
| Bonos del Tesoro | |
| Cupones de Bonos | |
| Letras del Tesoro | |
| Depósitos a Plazo Fijo | 17.949.360,69 |
| Letras del Banco Central de Bolivia | |
| Letras BCB Prepagables | |
| Pagarés Bursátiles | |
| Valores de Contenido Crediticio | |
| **Total** | **19.854.313,30** |

**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% |
| | | BIS | | 3,00% | | | | |
| | | BME | | 3,65% | | | | |
| | | BTB | 3,65% | | | | | |
| | | BUN | 3,50% | | | | | |
| | | FEF | | 3,00% | | | | |
| | | FFO | | | | | | 3,00% |
| | | FIE | | 3,00% | | | | |
| | BBB | BEC | | | | | | 3,00% |
| | | BUN | | | | | | 3,00% |
| | | FIE | | | 3,00% | | | |
| | BLP | BNL | | | | | | 3,00% |
| | | SOF | | | 3,00% | | | |
| USD | BBB | BME | | | 1,00% | | | |
| | | FIE | | | 1,00% | | | |
| | BLP | TSM | | | | | 1,00% | |

**Fuente: BBV**

## IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 21/02/2024

| Mercado Bursátil | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | Prom. Ponderado | | | Tasas | |
| Moneda | CVT | Reporto | General | Min | Max |
| Plazos Hasta 45 Días | | | | | |
| MN | | 3,14% | 3,14% | 3,00% | 3,65% |
| 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 | 21-feb.-2024 | Var. (%) Diaria | 15-feb.-2024 | Var. (%) Diaria | 21-feb.-2024 | Var. (%) Diaria | 21-feb.-2024 | Var. (%) Diaria |
| 4 | 5,39 ⇨ | (0,00%) | 7,19 ⇨ | (0,00%) | 11,00 ⇨ | (0,00%) | 5,44 ⇧ | (0,01%) |
| 13 | 5,22 ⇨ | (0,00%) | - | | 11,35 ⇨ | (0,00%) | 5,58 ⇩ | -(0,01%) |
| 26 | 5,11 ⇧ | (0,01%) | - | | 11,33 ⇨ | (0,00%) | 5,67 ⇩ | -(0,02%) |
| 52 | - | | - | | 11,22 ⇨ | (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 21-feb.-2024 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | Var. (%) Diaria | | | Var. (%) Diaria |
| Argentina | 837,85 ⇧ | (0,55%) | México | 17,08 ⇧ | (0,01%) |
| Brasil | 4,94 ⇧ | (0,01%) | Uruguay | 39,10 ⇧ | (0,05%) |
| Chile | 971,97 ⇧ | (9,16%) | Reino Unido | 0,79 ⇨ | (0,00%) |
| Perú | 3,80 ⇧ | (0,02%) | Unión Europea | 0,93 ⇨ | (0,00%) |

(l) Respecto al dólar