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

Información del 29-12-2023 al 2-01-2024

OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

TIPO DE CAMBIO		
Fecha	Compra	Venta
2/1/2024	6,86	6,96

UFV
2,47466

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

i. Oferta de Valores en Mesa de Dinero vigente del 29/12/2023 al 02/01/2024

Valor	Emisor	Plazo (días)	Periodo de protección (a)	Cantidad de valores disponible (b)	TR (%)
LB-MN	BCB	63	-	75.000	0,7500
LB-MN	BCB	91	-	25.000	1,0000
LB-MN	BCB	182	-	75.000	2,7000
LR-MN	BCB	273	91	294.858	3,7500
LR-MN	BCB	364	91	341.157	4,0000

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 29/12/2023

Moneda	Saldo al	T. Premio Prom.	Monto	Plazo Prom. (días)
MN	29/12/2023	5,50%	233.655.000,00	42
		Total Vigente	233.655.000,00	

ii. Vencimientos Reportos de 02/01/2024

Moneda	F. de Reporto	T. Premio	Monto Inicial	Plazo (días)
MN	23/11/2023	5,50	1.700.000,00	40

iii. Oferta diaria de Reportos vigente del 28/12/2023 al 03/01/2024

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 28/12/2023 al 03/01/2024.

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%) 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 01/2024

Miércoles 03/01/2024 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	40.000
LB-MN	BCB	09:20	-	MN	63	Competitiva	75.000
LB-MN	BCB	09:30	-	MN	91	Competitiva	75.000
LB-MN	BCB	09:40	-	MN	182	Competitiva	75.000
LR-MN	BCB	09:50	91	MN	273	Competitiva	300.000
LR-MN	BCB	10:00	91	MN	364	Competitiva	500.000
BR-MU 0,80%	BCB	09:10	91	UFV	546	Competitiva	20.000
BR-MU 1,30%	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
22-dic	4,50%	8,00%	6,39%	17	12.600	-	-	-	-	-
26-dic	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
27-dic	4,50%	8,00%	5,91%	21	20.892	-	-	-	-	-
28-dic	4,50%	4,50%	4,50%	1	5.800	-	-	-	-	-
29-dic	4,50%	9,00%	8,07%	10	23.370	2,00%	2,00%	2,00%	7	5.000

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 29/12/2023

Instrumentos	Monto negociado (en dólares americanos)
Bonos Bancarios Bursátiles	2.069,97
Bonos del Banco Central de Bolivia	
Bonos de Largo Plazo	25.946,06
Bonos BCB Prepagables	
Bonos Municipales	
Bonos del Tesoro	
Cupones de Bonos	
Letras del Tesoro	
Depósitos a Plazo Fijo	14.268.852,63
Letras del Banco Central de Bolivia	
Letras BCB Prepagables	8.754.552,99
Pagarés Bursátiles	447.556,85
Valores de Contenido Crediticio	
Total	**23.498.978,50**

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		4,10%				
		BIS		3,50%				
		BME						3,00%
		BNB			3,00%			
		BSO						3,00%
		FFO						3,00%
		FIE			3,70%	3,80%		
		NFB						3,00%
	BBB	FEF			4,00%			
	BLP	BIL		3,50%				
		CMI			4,00%			
		DMT			4,00%			
		ITA		3,50%				
	LRS	BCB	3,29%					3,00%
	PGB	NUT			4,00%			
		POL			4,00%			
		TSM		5,00%				

Fuente: BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 29/12/2023

Mercado Bursátil					
	Prom. Ponderado			Tasas	
Moneda	CVT	Reporto	General	Min	Max
Plazos Hasta 45 Días					
MN	3,50%	3,12%	3,13%	3,00%	4,10%
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	29-dic.-2023	Var. (%) Diaria	26-dic.-2023	Var. (%) Diaria	29-dic.-2023	Var. (%) Diaria	29-dic.-2023	Var. (%) Diaria
4	5,40 ⇧	(0,02%)	8,25 ⇨	(0,00%)	11,26 ⇨	(0,00%)	5,47 ⇨	(0,00%)
13	5,18 ⇩	-(0,03%)	-		11,27 ⇨	(0,00%)	5,59 ⇨	(0,00%)
26	5,05 ⇧	(0,02%)	-		11,30 ⇨	(0,00%)	5,59 ⇧	(0,01%)
52	-		-		11,12 ⇨	(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 29-dic.-2023					
		Var. (%) Diaria			Var. (%) Diaria
Argentina	808,48 ⇧	(0,48%)	México	16,98 ⇧	(0,05%)
Brasil	4,86 ⇨	(0,00%)	Uruguay	38,87 ⇩	-(0,22%)
Chile	881,00 ⇩	-(4,28%)	Reino Unido	0,78 ⇩	-(0,01%)
Perú	3,71 ⇧	(0,01%)	Unión Europea	0,91 ⇧	(0,01%)

(l) Respecto al dólar