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

Información del 30-01-2024 al 31-01-2024

OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

TIPO DE CAMBIO		
Fecha	Compra	Venta
31/1/2024	6,86	6,96

UFV
2,47848

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

No existe oferta

B. OPERACIONES DE REPORTO

i. Reportos Vigentes al 30/01/2024

Moneda	Saldo al	T. Premio Prom.	Monto *	Plazo Prom. (días)
MN	30/01/2024	5,50%	176.683.000,00	39
		Total Vigente	176.683.000,00	

ii. Vencimientos Reportos de 31/01/2024

No hubo vencimientos

iii. Oferta diaria de Reportos vigente del 25/01/2024 al 31/01/2024

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 25/01/2024 al 31/01/2024.

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%), 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 05/2024

Miércoles 31/01/2024 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	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
24-ene	6,00%	6,00%	6,00%	28	11.662	-	-	-	-	-
25-ene	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26-ene	8,00%	8,00%	8,00%	28	8.500	-	-	-	-	-
29-ene	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
30-ene	4,50%	8,00%	6,75%	19	10.600	-	-	-	-	-

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 30/01/2024

Instrumentos	Monto negociado (en dólares americanos)
Bonos Bancarios Bursátiles	
Bonos del Banco Central de Bolivia	
Bonos de Largo Plazo	
Bonos BCB Prepagables	
Bonos Municipales	
Bonos del Tesoro	
Cupones de Bonos	1.675.881,20
Letras del Tesoro	
Depósitos a Plazo Fijo	1.420.367,36
Letras del Banco Central de Bolivia	
Letras BCB Prepagables	
Pagarés Bursátiles	
Valores de Contenido Crediticio	
Total	**3.096.248,56**

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	BIS		4,10%				3,00%
		BME						3,00%
		BSO				3,20%		
		FFO						3,00%
	CUP	TGN						3,00%
USD	DPF	BNB						0,50%

Fuente: BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 30/01/2024

Mercado Bursátil					
	Prom. Ponderado			Tasas	
Moneda	CVT	Reporto	General	Min	Max
Plazos Hasta 45 Días					
MN	3,09%	3,09%	3,09%	3,00%	4,10%
MU					
ME		0,50%	0,50%	0,50%	0,50%
MY					
MV					

Fuente: BBV

V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO

Plazo	EEUU		Chile $		Méx MN(j)		Libor ($us)	
semanas	30-ene.-2024	Var. (%) Diaria	30-ene.-2024	Var. (%) Diaria	30-ene.-2024	Var. (%) Diaria	30-ene.-2024	Var. (%) Diaria
4	5,37 ⇩	-(0,01%)	-		11,15 ⇩	-(0,13%)	5,44 ⇩	-(0,01%)
13	5,20 ⇧	(0,02%)	-		11,29 ⇨	(0,00%)	5,57 ⇨	(0,00%)
26	4,99 ⇧	(0,02%)	-		11,31 ⇧	(0,01%)	5,57 ⇩	-(0,01%)
52	-		-		11,21 ⇨	(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 30-ene.-2024					
		Var. (%) Diaria			Var. (%) Diaria
Argentina	825,75 ⇧	(0,49%)	México	17,16 ⇩	-(0,07%)
Brasil	4,96 ⇧	(0,01%)	Uruguay	39,15 ⇧	(0,02%)
Chile	934,13 ⇧	(3,69%)	Reino Unido	0,79 ⇨	(0,00%)
Perú	3,81 ⇨	(0,00%)	Unión Europea	0,92 ⇨	(0,00%)

(l) Respecto al dólar