

**OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO**

| TIPO DE CAMBIO |        |       | UFV     |
|----------------|--------|-------|---------|
| Fecha          | Compra | Venta |         |
| 17/11/2020     | 6,86   | 6,96  | 2,35952 |

**I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO****A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO****i. Vigente del 13/11/2020 al 17/11/2020**

No existe oferta regular

**B. OPERACIONES DE REPORTE****i. Operaciones de Reporto vigentes**

| Moneda               | F. Operación | T. Premio % | Monto          | Plazo en días | F. Vencimiento |
|----------------------|--------------|-------------|----------------|---------------|----------------|
| MN                   | 21/09/2020   | 2,00        | 18.169.221,84  | 60            | 20/11/2020     |
| MN                   | 24/09/2020   | 2,00        | 5.144.578,96   | 60            | 23/11/2020     |
| MN                   | 30/09/2020   | 2,00        | 12.589.200,00  | 57            | 26/11/2020     |
| MN                   | 08/10/2020   | 2,00        | 12.558.000,00  | 60            | 07/12/2020     |
| MN                   | 12/10/2020   | 2,00        | 6.404.670,63   | 60            | 11/12/2020     |
| MN                   | 15/10/2020   | 2,00        | 10.084.146,99  | 55            | 09/12/2020     |
| MN                   | 15/10/2020   | 2,00        | 1.921.558,45   | 56            | 10/12/2020     |
| MN                   | 20/10/2020   | 2,00        | 1.086.820,08   | 58            | 17/12/2020     |
| MN                   | 20/10/2020   | 2,00        | 20.195.096,84  | 50            | 09/12/2020     |
| MN                   | 21/10/2020   | 2,00        | 48.591.100,00  | 58            | 18/12/2020     |
| MN                   | 22/10/2020   | 2,00        | 64.339.280,00  | 60            | 21/12/2020     |
| MN                   | 03/11/2020   | 2,00        | 9.635.466,00   | 45            | 18/12/2020     |
| MN                   | 03/11/2020   | 2,00        | 5.320.734,18   | 45            | 18/12/2020     |
| MN                   | 05/11/2020   | 2,00        | 4.039.169,20   | 60            | 04/01/2021     |
| MN                   | 09/11/2020   | 2,00        | 17.759.278,44  | 59            | 07/01/2021     |
| MN                   | 09/11/2020   | 2,00        | 1.288.807,40   | 45            | 24/12/2020     |
| MN                   | 09/11/2020   | 2,00        | 1.933.211,10   | 45            | 24/12/2020     |
| MN                   | 09/11/2020   | 2,00        | 1.288.807,39   | 45            | 24/12/2020     |
| MN                   | 09/11/2020   | 2,00        | 100.998.311,98 | 60            | 08/01/2021     |
| MN                   | 09/11/2020   | 2,00        | 17.759.278,44  | 60            | 08/01/2021     |
| MN                   | 10/11/2020   | 2,00        | 27.631.631,44  | 57            | 06/01/2021     |
| MN                   | 10/11/2020   | 2,00        | 3.817.953,80   | 59            | 08/01/2021     |
| MN                   | 10/11/2020   | 2,00        | 12.436.200,00  | 59            | 08/01/2021     |
| MN                   | 11/11/2020   | 2,00        | 5.006.416,78   | 57            | 07/01/2021     |
| MN                   | 16/11/2020   | 2,00        | 9.963.891,02   | 60            | 15/01/2021     |
| MN                   | 16/11/2020   | 2,00        | 3.508.614,65   | 60            | 15/01/2021     |
| MN                   | 16/11/2020   | 2,00        | 11.090.340,51  | 60            | 15/01/2021     |
| <b>Total Vigente</b> |              |             | 434.561.786,12 |               |                |

**ii. Reportos Excepcionales vigentes**

| Moneda               | F. Operación      | T. Premio % Promedio | Monto *)         | Plazo en días  | F. Vencimiento |            |
|----------------------|-------------------|----------------------|------------------|----------------|----------------|------------|
| MN                   | Ent. Bancarias    | 02/10/2020           | 0,20             | 622.474.355,58 | 90             | 31/12/2020 |
| MN                   | Ent. No Bancarias | 02/10/2020           | 0,20             | 91.622.547,79  | 90             | 31/12/2020 |
| MN                   | Ent. Bancarias    | 09/10/2020           | 0,20             | 478.064.462,34 | 90             | 07/01/2021 |
| MN                   | Ent. No Bancarias | 09/10/2020           | 0,20             | 23.324.655,44  | 90             | 07/01/2021 |
| MN                   | Ent. Bancarias    | 16/10/2020           | 0,50             | 100.000.000,00 | 90             | 14/01/2021 |
| MN                   | Ent. No Bancarias | 16/10/2020           | 0,50             | 99.237.815,66  | 90             | 14/01/2021 |
| MN                   | Ent. Bancarias    | 23/10/2020           | 0,20             | 150.000.000,00 | 90             | 21/01/2021 |
| MN                   | Ent. No Bancarias | 23/10/2020           | 0,48             | 29.399.673,88  | 90             | 21/01/2021 |
| MN                   | Ent. Bancarias    | 30/10/2020           | 0,50             | 29.999.999,99  | 90             | 28/01/2021 |
| MN                   | Ent. No Bancarias | 30/10/2020           | 0,50             | 4.281.573,12   | 90             | 28/01/2021 |
| <b>Total Vigente</b> |                   |                      | 1.628.405.083,80 |                |                |            |

\*)En fecha 15-10-2020, cancelación anticipada por Bs15.544.849,67 de f. 2/10/2020

**iii. Oferta diaria de Reportos**

(\*) Vigente del 12/11/2020 al 18/11/2020

Para Valores Públicos y Valores de Emisores Privados (DPF)

| Moneda | Monto Diario Disponible desde 12-06-20 | Tasa        | TEA (e) | Tasa     | TEA (e) | Plazo (En días) | Tasa de Valoración (g) |
|--------|--|-------------|---------|----------|---------|-----------------|------------------------|
|        |  | Subasta (d) | Subasta | Mesa (f) | Mesa    |                 |                        |
| MN     | 250.000.000                            | 2,00%       | 2,02%   | 2,50%    | 2,53%   | 60              | 7,00%                  |
| ME     | 5.000.000                              | 4,00%       | 4,08%   | 4,50%    | 4,60%   | 15              | 12,50%                 |

d) Tasa vigente del 12/11/2020 al 18/11/2020.

e) TEA referencial calculada para un plazo de 60 días (MN) y 15 días (ME).

f) 50 puntos básicos sobre la tasa premio más alta adjudicada en subasta.

g) Tasa para determinar el valor de toa en una operación de reporte. Para MN con valores de emisores privados: DPF AAA (8,50%), DPF AA1 (9,00%), DPF AA2 (9,70%), DPF AA3 (10,60%) y DPF A(11,70). Para MN-UFV la tasa es 5,00%.

iv. Tasas para Créditos con garantía del Fondo RAL (h)

| Tramos | MN    | TEA (i) | ME    | TEA (i) |
|--------|-------|---------|-------|---------|
| 1er    | 2,50% | 2,53%   | 5,50% | 5,65%   |
| 2do    | 3,00% | 3,04%   | 6,00% | 6,18%   |

h) Estas operaciones se realizan directamente con la Gerencia de Entidades Financieras del BCB.

i) TEA calculada para un plazo de 7 días.

C. OFERTA DE VALORES EN SUBASTA  
i. Subasta Electrónica de Valores Públicos de la semana 47/2020  
miércoles 18/11/2020 Apertura: Hrs.9:00 am.

| Valor | Emisor | Cierre | Período de protección (j) | Moneda | Plazo (En días) | Modalidad   | Cantidad de Títulos(k) |
|-------|--------|--------|---------------------------|--------|-----------------|-------------|------------------------|
| LB-MN | BCB    | 09:10  | -                         | MN     | 91              | Competitiva | 20.000                 |

j) En días, corresponde a los títulos con opción de rescate anticipado.

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

II MERCADO MONETARIO

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

| i) Moneda Nacional |       |       |            |             |        | ii) Moneda Extranjera |       |            |             |       |
|--------------------|-------|-------|------------|-------------|--------|-----------------------|-------|------------|-------------|-------|
| Fecha al:          | Min.  | Max.  | Prom. (**) | Plazo Prom. | Monto  | Min.                  | Max.  | Prom. (**) | Plazo Prom. | Monto |
| 10-nov             | 6,50% | 6,90% | 6,58%      | 16          | 80.000 | 3,00%                 | 3,00% | 3,00%      | 20          | 6.000 |
| 11-nov             | 7,50% | 7,50% | 7,50%      | 15          | 50.000 | 3,50%                 | 3,50% | 3,50%      | 5           | 3.000 |
| 12-nov             | 7,60% | 8,50% | 8,04%      | 9           | 35.000 | -                     | -     | -          | -           | -     |
| 13-nov             | 7,90% | 8,50% | 8,18%      | 10          | 50.000 | -                     | -     | -          | -           | -     |
| 16-nov             | 8,50% | 8,70% | 8,64%      | 6           | 50.000 | 3,70%                 | 3,70% | 3,70%      | 4           | 3.000 |

Operaciones interbancarias realizadas por sondeo. Datos Preliminares.

(\*) Incluye operaciones de Entidades Financieras de Vivienda.

(\*\*) Promedio Ponderado por monto y plazo.

III. OPERACIONES DE REPORTO REALIZADAS EN LA BOLSA BOLIVIANA DE VALORES 16/11/2020

| Instrumentos                        | Monto negociado<br>(en dólares americanos) | Moneda | Valores | Tasas de rendimiento según rango de plazo en días |        |         |         |         |         |       |
|-------------------------------------|--|--------|---------|---|--------|---------|---------|---------|---------|-------|
|                                     |  |        |         | 1 - 7   | 8 - 15 | 16 - 22 | 23 - 30 | 31 - 37 | 38 - 45 |       |
| Bonos Bancarios Bursátiles          | 174.927,11                                 | BS     | BIS     |   | 6,50%  |         |         |         |         |       |
| Bonos del Banco Central de Bolivia  |  |        | BME     |   |        | 5,50%   |         | 7,50%   |         |       |
| Bonos de Largo Plazo                |  |        | BNB     |   |        |         | 7,50%   |         |         | 6,50% |
| Bonos Municipales                   |  |        | BSO     |   | 8,50%  |         |         |         |         |       |
| Bonos del Tesoro                    | 8.011.558,48                               |        | BTB     |   |        |         |         | 7,50%   |         | 5,50% |
| Cupones de Bonos                    |  |        | FEF     |   |        | 9,00%   | 7,50%   |         | 8,50%   |       |
| Letras del Tesoro                   |  |        | FFO     |   |        | 6,68%   | 9,00%   |         |         | 5,50% |
| Depósitos a Plazo Fijo              | 24.286.539,19                              |        | FIE     |   |        | 8,00%   |         | 7,15%   |         | 7,00% |
| Letras del Banco Central de Bolivia |  |        | FSL     |   |        |         | 8,90%   |         |         |       |
| Letras BCB Prepagables              |  |        | NFB     |   | 7,50%  |         |         | 8,00%   |         |       |
| Pagarés Bursátiles                  |  |        | BBB     |   |        |         |         |         | 5,00%   |       |
| Valores de Contenido Crediticio     | 205.636,80                                 |        | BTS     |   |        |         | 12,00%  |         | 6,50%   |       |
| <b>Total</b>                        | <b>32.678.661,58</b>                       |        | VTD     |   |        |         |         |         |         | 7,70% |
|                                     |  |        | PCI     |   |        |         |         | 6,50%   |         |       |

Fuente: BBV

Fuente: BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 16/11/2020

| Moneda               | Mercado Bursátil |         |         |       |       |
|----------------------|------------------|---------|---------|-------|-------|
|                      | CVT              | Reporto | General | Min   | Max   |
| Plazos Hasta 45 Días |                  |         |         |       |       |
| MN                   | 2,96%            | 7,59%   | 7,42%   | 2,96% | 9,00% |
| MU                   |                  |         |         |       |       |
| ME                   |                  |         |         |       |       |
| MV                   |                  |         |         |       |       |
| MV                   |                  |         |         |       |       |

Fuente: BBV

V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO

| Plazo semanas | EEUU        | Arg \$     | Chile \$   | Méx MN(k)   | Libor (\$us) |
|---------------|-------------|------------|------------|-------------|--------------|
|               | 16-nov-2020 | 9-nov-2020 | 9-nov-2020 | 16-nov-2020 | 16-nov-2020  |
| 4             | 0,09        | -          | -          | 4,24        | 0,136        |
| 13            | 0,08        | -          | -          | 4,30        | 0,222        |
| 26            | 0,09 ↓      | -          | -          | 4,35        | 0,246        |
| 52            | -           | -          | -          | 4,36        | 0,339        |
| Prime Rate    |             | 3,25       |            |             |              |
| Fed Funds     |             | 0,09       |            |             |              |

(k) Mercado Secundario.

B. TIPOS DE CAMBIO

| TIPO DE CAMBIO (l) al 16-nov-2020 |           |               |           |
|-----------------------------------|-----------|---------------|-----------|
| Argentina                         | 79,956 ↑  | Japón         | 104,550 ↓ |
| Reino Unido                       | 0,758 ↓   | México        | 20,313 ↓  |
| Brasil                            | 5,432 ↓   | Perú          | 3,666 ↑   |
| Chile                             | 766,410 ↓ | Unión Europea | 0,8442 ↓  |

(l) Respecto al dólar

Atentamente,

LA SUBGERENCIA DE OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO DEL BANCO CENTRAL DE BOLIVIA