



Información del 2-04-2020 al 3-04-2020

OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

TIPO DE CAMBIO			UFV
Fecha	Compra	Venta	
03/04/2020	6,86	6,96	2,34110

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

No existe oferta

B. OPERACIONES DE REPORTO

i. Operaciones de Reporto vigentes

Moneda	F. Operación	T. Premio %	Monto	Plazo en días	F. Vencimiento
MN	21/02/2020	3,00	27.869.182,10	45	06/04/2020
MN	21/02/2020	2,75	4.368.536,14	45	06/04/2020
MN	27/02/2020	2,75	1.911.889,54	42	09/04/2020
MN	28/02/2020	3,10	11.315.800,00	45	13/04/2020
MN	28/02/2020	2,75	5.274.202,22	40	08/04/2020
MN	02/03/2020	2,75	1.021.392,35	45	16/04/2020
MN	02/03/2020	2,75	4.823.851,26	45	16/04/2020
MN	05/03/2020	2,75	27.874.171,60	35	09/04/2020
MN	05/03/2020	2,75	9.262.854,40	43	17/04/2020
MN	09/03/2020	2,75	17.170.400,00	45	23/04/2020
MN	11/03/2020	2,75	22.008.173,16	44	24/04/2020
MN	13/03/2020	2,75	28.539.600,00	45	27/04/2020
MN	13/03/2020	2,75	2.529.288,45	45	27/04/2020
MN	16/03/2020	2,75	4.524.144,08	43	28/04/2020
MN	16/03/2020	2,75	13.183.500,00	45	30/04/2020
MN	19/03/2020	2,75	12.843.700,00	42	30/04/2020
MN	20/03/2020	2,75	4.513.977,03	40	29/04/2020
MN	23/03/2020	2,75	14.907.630,40	45	07/05/2020
MN	24/03/2020	2,75	16.218.695,79	45	08/05/2020
MN	26/03/2020	2,75	30.423.116,85	43	08/05/2020
MN	27/03/2020	3,90	71.500.754,80	45	11/05/2020
MN	27/03/2020	2,75	1.727.282,65	45	11/05/2020
MN	01/04/2020	2,75	1.799.943,56	44	15/05/2020

Total Vigente Bs 335.612.086,38

*) En fecha 2/04/2020 hubo cancelación anticipada por Bs119.576.583,15 correspondiente a la operación de fecha 26/03/2020.

ii. Oferta diaria de Reportos

(*) Vigente del 02/04/2020 al 15/04/2020

Para Valores Pùblicos y Valores de Emisores Privados (DPF)

Moneda	Monto Diario Disponible desde 7-11-19	Tasa Subasta (d)	TEA (e)	Tasa Mesa (f)	TEA (e)	Plazo (En días)	Tasa de Valoración (g)
			Subasta	Subasta	Mesa	Máximo	
MN	150.000.000	2,75%	2,78%	3,25%	3,29%	60	7,75%
ME	5.000.000	4,00%	4,08%	4,50%	4,60%	15	12,50%

d) Tasa vigente del 02/04/2020 al 15/04/2020.

e) TEA referencial calculada para un plazo de 45 días (MN) y 15 días (ME).

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

g) Tasa utilizada para determinar el Valor de Ida en una operación de reporto. Para MN con valores de emisores privados: DPF AAA (9,25%), DPF AA1 (9,75%), DPF AA2 (10,45%), DPF AA3 (11,35%) y DPF A1 (12,45%). Para MN-UFV la tasa es 5,75%.

iii. Tasas para Créditos con garantía del Fondo RAL (b)

Tramos	MN	TEA (i)	ME	TEA (i)
1er	3,25%	3,30%	5,50%	5,65%
2do	3,75%	3,82%	6,00%	6,18%

b) 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 16/2020

miércoles 15/04/2020 Apertura: Hrs.9:00 am.

Valor	Emisor	Cierre	Periodo de protección (j)	Moneda	Plazo (En días)	Modalidad	Cantidad
LB-MN	BGB	09:10	-	MN	91	Competitiva	50.000
BT-MN 3,20%	TGN	09:10	-	MN	3.640	Competitiva	20.000
BT-MN 3,60%	TGN	09:20	-	MN	5.460	Competitiva	60.000
BT-MN 3,80%	TGN	09:30	-	MN	7.280	Competitiva	200.000
BT-MN 4,00%	TGN	09:40	-	MN	10.920	Competitiva	200.000
BT-MN 4,10%	TGN	09:50	-	MN	18.200	Competitiva	120.000

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

II MERCADO MONETARIO

OPERACIONES INTERBANCARIAS DEL SISTEMA BANCARIO (*)

(en miles)

i) Moneda Nacional

Fecha al:	Min.	Max.	Prom. (**)	Plazo Prom.	Monto	Min.	Max.	Prom. (**)	Plazo Prom.	Monto
27-mar	8,60%	8,65%	8,63%	7	115.000	-	-	-	-	-
30-mar	8,60%	8,60%	8,60%	7	30.000	-	-	-	-	-
31-mar	8,60%	9,00%	8,86%	8	70.000	-	-	-	-	-
01-abr	8,80%	8,80%	8,80%	7	35.000	-	-	-	-	-
02-abr	8,80%	8,80%	8,80%	8	95.000	2,80%	2,80%	2,80%	7	10.000

Operaciones interbancarias realizadas por sondeo. Datos Preliminares.

(*) Induye operaciones de Entidades Financieras de Vivienda.

(**) Promedio Ponderado por monto y plazo.

III. OPERACIONES DE REPORTO REALIZADAS EN LA BOLSA BOLIVIANA DE VALORES 02/04/2020

Instrumentos	Monto negociado (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	301.994,17		BEC						3,00%
Bonos del Banco Central de Bolivia			BGA						2,79%
Bonos de Largo Plazo	327.667,37		BIS						3,00%
Bonos Municipales			BME	3,00%					4,00%
Bonos del Tesoro	437.300,26		BNB	3,00%					4,00%
Cupones de Bonos			BSO						3,50%
Depósitos a Plazo Fijo	30.191.935,64	DPF	BTB						3,50%
Letras del Banco Central de Bolivia			BUN						3,00%
Letras BCB Prepagables			FCO						2,70%
Pagarés Bursátiles			FEF	3,40%					
Valores de Contenido Crediticio	932.215,74		FFO		3,89%		3,95%		4,00%
Total	32.191.113,18		FSL						4,50%
Fuente: BBV			NFB					2,80%	3,13%
			FFF						4,20%
			FOO						4,20%
			NIB						3,80%
			PAR						4,20%
			BTS		5,50%				
			VTD						4,50%
		USD	DPF						4,20%
			BLP	0,50%					
			POL						

Fuente: BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 02/04/2020

Moneda	CVT	Reporto	General	Min	Max
Plazos Hasta 45 Días					
MN		3,03%	3,03%	2,70%	4,50%
MU					
ME		0,80%	0,80%	0,80%	0,80%
MY					
MV					

Fuente: BBV

V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO

Plazo semanas	EEUU 2-abr-2020	Arg \$ 30-mar-2020	Chile \$ 30-mar-2020	Méx MN _(k) 2-abr-2020	Líbor (\$us) 2-abr-2020
4	0,03	-	-	6,31 ↓	0,982 ↓
13	0,06 ↑	-	-	6,28 ↓	1,373 ↓
26	0,13 ↑	-	-	6,13 ↓	1,205 ↑
52	-	-	-	6,08	1,060 ↑
Prime Rate		3,25			
Fed Funds		0,06 ↓			

(k) Mercado Secundario.

B. TIPOS DE CAMBIO

TIPO DE CAMBIO (l) al 2-abr-2020
Argentina 64,711 ↑
Reino Unido 0,808 ↑
Brasil 5,266 ↑
Chile 861,300 ↓
Japón 107,880 ↑
México 24,101 ↓
Perú 3,458 ↓
Unión Europea 0,9209 ↑

(l) Respecto al dólar

Atentamente,

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