Información del 05-10-2018 al 08-10-2018

OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

TIPO DE CAMBIO			UFV
Fecha	Compra	Venta	
08/10/2018	6,86	6,96	2,28439

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

i. Vigente del 05/10/2018 al 09/10/2018

Valor	Moneda	Plazo en días	Periodo de protección (a)	Cantidad de valores (b)	TR % (c)
LR	MN	273	91	143.961	0,6500

a) En dias, 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.

c) Tasa de rendimiento efectiva.

B. OPERACIONES DE REPORTO

i. Operaciones de Reporto vigentes

No existen operaciones Vigentes.

ii. Oferta diaria máxima de Reportos

(*) Vigente del 04/10/2018 al 17/10/2018

Moneda	Monto Diario Disponible desde 23-10-14	Tasa Subasta (e)	TEA (f) Subasta	Tasa Mesa (g)	TEA (f) Mesa	Plazo (En días) Máximo	Tasa de Valoración (h)
MN	600.000.000	2,50%	2,53%	3,00%	3,04%	15	7,50%
ME	5.000.000	4,00%	4,08%	4,50%	4,60%	15	12,50%

e) Tasa vigente del 04/10/2018 al 17/10/2018.

f) TEA referencial calculada para un plazo de 15 días.

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

h) Tasa de valoración utilizada para determinar el valor de ida de una operación de reporto con colaterales en MN y ME. Para colaterales en UFV la tasa es 5,50%

iii. Créditos con garantía del Fondo RAL (i)

Tramos	MN	TEA (j)	ME	TEA (j)
1er	4,00%	4,08%	5,50%	5,65%
2do	4,50%	4,60%	6,00%	6,18%

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

j) TEA calculada para un plazo de 7 días.

C. DEPÓSITO ESPECIAL DE REGULACIÓN MONETARIA

i. Operaciones de DERM vigentes

No existe oferta

D. OFERTA DE VALORES EN SUBASTA

i. Subasta Electrónica de Valores Públicos de la semana 42/2018

miércoles 17/10/2018 Apertura: Hrs.9:00 am.

Valor	Emisor	Cierre	Periodo de protección (j)	Moneda	Plazo (En días)	Modalidad	Cantidad
LR-MN	BCB	09:10	91	MN	182	Competitiva	100.000
LR-MN	BCB	09:20	91	MN	273	Competitiva	300.000
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					ii) Moneda Extranjera				
Fecha al:	Min.	Max.	Prom. (**)	Plazo Prom.	Monto	Min.	Max.	Prom. (**)	Plazo Prom.	Monto
01-oct	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
02-oct	-	-	-	-	-	2,80%	2,80%	2,80%	28	6.000
03-oct	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
04-oct	-	-	-	-	-	2,70%	2,80%	2,76%	20	2.500
05-oct	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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 EL RUEDO DE LA BOLSA BOLIVIANA DE VALORES 05/10/2018

Instrumentos	Monto negociado (en dólares americanos)
Bonos Bancarios Bursátiles	709.008,03
Bonos del Banco Central de Bolivia	
Bonos de Largo Plazo	1.138.725,28
Bonos Municipales	
Bonos del Tesoro	11.033.814,52
Cupones de Bonos	
Depósitos a Plazo Fijo	40.042.502,47
Letras del Banco Central de Bolivia	
Letras BCB Prepagables	
Pagarés Bursátiles	
Valores de Contenido Crediticio	340.825,79
Total	53.264.876,09

Fuente: BBV

Moneda		Valores	Tasas de rendimiento según rango de plazo en días					
			1 - 7	8 - 15	16 - 22	23 - 30	31 - 37	38 - 45
BS	DPF	BEC						2,13%
		BME	2,50%				2,35%	2,68%
		BNB						2,10%
		BSO	2,39%					2,00%
		BTB						2,02%
		BUN	2,34%	2,44%				
		FCO						3,50%
		FEF						2,10%
		FIE		2,30%				
		FPR						2,10%
		FSL						3,00%
	BBB	BEC						2,00%
		BNB						2,20%
		FIE						2,20%
	BLP	BPC						2,00%
		FEF						2,10%
		IOL						2,00%
		TYS					2,00%	
	BTS	TGN			2,00%			2,00%
	VTD	FUB						2,13%
USD	DPF	BUN						1,00%

Fuente: BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 05/10/2018

	Mercado Bursátil					Mercado Extrabursátil			Consolidado		
	Prom. Ponderado			Tasas		Prom.	Tasas		Prom.	Tasas	
Moneda	CVT	Reporto	General	Min	Max	Extrabursátil	Min	Max	General	Min	Max
Plazos Hasta 45 Días											
ME		1,00%	1,00%	1,00%	1,00%						
MN	2,84%	2,28%	2,31%	2,00%	3,50%						
MV											

Fuente: BBV

V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO

Plazo semanas	EEUU 5-oct-2018	Arg $ 21-sep-2018	Chile $ 21-sep-2018	Méx MN(m) 5-oct-2018	Libor ($us) 5-oct-2018
4	2,15 ⇩	-	2,50	7,72 ⇧	2,277 ⇩
13	2,17	-	-	7,86 ⇩	2,408 ⇩
26	2,35	-	-	8,04 ⇧	2,623 ⇩
52	-	-	-	8,15 ⇧	2,958 ⇧
Prime Rate		5,25			
Fed Funds		2,18			

(m) Mercado Secundario.

B. TIPOS DE CAMBIO

TIPO DE CAMBIO (e) al 5-oct-18			
Argentina	37,852 ⇩	Japón	113,680 ⇩
Reino Unido	0,763 ⇩	México	18,818 ⇩
Brasil	3,844 ⇩	Perú	3,324 ⇩
Chile	677,330 ⇧	Unión Europea	0,8681 ⇩

(e) Respecto al dólar

Atentamente,

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