



Información del 07-09-2018 al 10-09-2018

## OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

| TIPO DE CAMBIO |        |       | UFV     |
|----------------|--------|-------|---------|
| Fecha          | Compra | Venta |         |
| 10/09/2018     | 6,86   | 6,96  | 2,28131 |

### I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

#### A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

##### i. Vigente del 07/09/2018 al 11/09/2018

| Valor    | Moneda | Plazo en días | Periodo de protección (a) | Cantidad de valores (b) | TR % (c) |
|----------|--------|---------------|---------------------------|-------------------------|----------|
| LR       | MN     | 273           | 91                        | 0                       | 0,6500   |
| BT 3,20% | MN     | 3.640         | -                         | 20.000                  | 2,4000   |
| BT 3,60% | MN     | 5.460         | -                         | 0                       | 2,7997   |
| BT 3,80% | MN     | 7.280         | -                         | 0                       | 2,8400   |
| BT 4,00% | MN     | 10.920        | -                         | 90.000                  | 2,9000   |
| BT 4,10% | MN     | 18.200        | -                         | 50.000                  | 3,3500   |

- 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.
- 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 06/09/2018 al 19/09/2018

| Moneda | Monto Diario Disponible desde 23-10-14 | Tasa        | TEA (f) | Tasa     | TEA (f) | Plazo (En días) Máximo | Tasa de Valoración (h) |
|--------|--|-------------|---------|----------|---------|------------------------|------------------------|
|        |  | Subasta (e) | Subasta | Mesa (g) | Mesa    |                        |                        |
| 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 06/09/2018 al 19/09/2018.

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 BCR.

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 38/2018

miércoles 19/09/2018 Apertura: Hrs. 9:00 am.

| Valor       | Emisor | Cierre | Periodo de protección (i) | 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  |

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

## II MERCADO MONETARIO

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

| Fecha al: | i) Moneda Nacional |       |            | Plazo Prom. | Monto  | ii) Moneda Extranjera |       |            | Plazo Prom. | Monto  |
|-----------|--------------------|-------|------------|-------------|--------|-----------------------|-------|------------|-------------|--------|
|           | Mín.               | Max.  | Prom. (**) |             |        | Mín.                  | Max.  | Prom. (**) |             |        |
| 03-sep    | 1,33%              | 1,33% | 1,33%      | 8           | 20.000 | 2,35%                 | 2,35% | 2,35%      | 17          | 900    |
| 04-sep    | -                  | -     | -          | -           | -      | 2,35%                 | 2,35% | 2,35%      | 7           | 12.000 |
| 05-sep    | -                  | -     | -          | -           | -      | 2,35%                 | 2,35% | 2,35%      | 11          | 6.500  |
| 06-sep    | -                  | -     | -          | -           | -      | -                     | -     | -          | -           | -      |
| 07-sep    | -                  | -     | -          | -           | -      | -                     | -     | -          | -           | -      |

Operaciones interbancarias realizadas por sondeo. Datos Preliminares.

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

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

### III. OPERACIONES DE REPORTE REALIZADAS EN EL RUEDO DE LA BOLSA BOLIVIANA DE VALORES 7/09/2018

| 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          | 516.618,08                                 | BS     | BEC     | 1,10%   | 1,20%  | 1,10%   |         |         | 1,30%   |
| Bonos del Banco Central de Bolivia  |  |        | BGA     | 1,10%   |        |         |         |         |         |
| Bonos de Largo Plazo                | 1.685.618,86                               |        | BIS     |   |        |         |         | 1,30%   |         |
| Bonos Municipales                   | 534.801,53                                 |        | BME     | 1,70%   |        |         |         |         | 1,60%   |
| Bonos del Tesoro                    | 9.564.067,06                               |        | BNB     | 1,44%   |        |         |         |         |         |
| Cupones de Bonos                    |  |        | BSO     |   |        |         |         | 1,20%   | 1,31%   |
| Depósitos a Plazo Fijo              | 42.524.084,41                              |        | BTB     | 1,43%   |        |         |         |         | 1,22%   |
| Letras del Banco Central de Bolivia |  |        | BUN     |   | 1,30%  |         |         |         | 1,50%   |
| Letras BCB Prepagables              |  |        | BSO     |   |        |         |         |         | 3,50%   |
| Pagarés Bursátiles                  |  |        | FEF     |   |        |         |         |         | 1,24%   |
| Valores de Contenido Crediticio     | 287.529,83                                 |        | FPR     | 2,00%   |        |         |         |         | 1,30%   |
| <b>Total</b>                        | <b>55.112.719,78</b>                       |        | BSO     |   |        |         |         |         | 1,80%   |
|                                     |  |        | FIE     |   |        |         |         |         | 1,80%   |
|                                     |  |        | ELP     |   |        |         | 2,00%   |         |         |
|                                     |  |        | FIN     |   |        |         |         |         | 1,80%   |
|                                     |  |        | NUT     |   |        |         |         |         | 1,50%   |
|                                     |  |        | PAP     |   | 2,00%  |         |         |         |         |
|                                     |  |        | PAR     |   | 2,00%  |         |         |         |         |
|                                     |  | SOF    |         |   |        |         |         | 1,80%   |         |
|                                     |  | MLP    |         |   |        |         |         | 1,80%   |         |
|                                     |  | TGN    |         | 1,50%   |        |         |         | 1,85%   |         |
|                                     |  | CRP    |         |   |        |         |         | 1,80%   |         |
|                                     |  | PMI    |         |   |        |         |         | 1,80%   |         |
|                                     |  | POL    |         |   |        |         |         | 0,50%   |         |
|                                     |  | TRA    |         |   |        |         |         | 0,50%   |         |

Fuente: BBV

### IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 7/09/2018

| Moneda               | Mercado Bursátil |         |         |       | Mercado Extrabursátil |       |     | Consolidado   |       |     |
|----------------------|------------------|---------|---------|-------|-----------------------|-------|-----|---------------|-------|-----|
|                      | Prom. Ponderado  |         | Tasas   |       | Prom. Extrabursátil   | Tasas |     | Prom. General | Tasas |     |
|                      | CVT              | Reporto | General | Min   |                       | Max   | Min |               | Max   | Min |
| Plazos Hasta 45 Días |                  |         |         |       |                       |       |     |               |       |     |
| ME                   |                  | 0,50%   | 0,50%   | 0,50% | 0,50%                 |       |     |               |       |     |
| MN                   |                  | 1,44%   | 1,44%   | 1,10% | 3,50%                 |       |     |               |       |     |
| MV                   |                  |         |         |       |                       |       |     |               |       |     |

Fuente: BBV

### V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

| A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO |                    |                       |                         |                                     | B. TIPOS DE CAMBIO         |                                |           |               |           |
|-------------------------------|--------------------|-----------------------|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------|--------------------------------|-----------|---------------|-----------|
| Plazo semanas                 | EEUU<br>7-sep-2018 | Arg \$<br>29-ago-2018 | Chile \$<br>29-ago-2018 | Méx MN <sub>(m)</sub><br>7-sep-2018 | Libor (\$us)<br>7-sep-2018 | TIPO DE CAMBIO (c) al 7-sep-18 |           |               |           |
| 4                             | 1,96 ↓             | -                     | 2,52                    | 7,72 ↑                              | 2,131 ↓                    | Argentina                      | 36,967 ↓  | Japón         | 111,000 ↑ |
| 13                            | 2,09               | -                     | -                       | 7,92                                | 2,331 ↑                    | Reino Unido                    | 0,774     | México        | 19,320 ↑  |
| 26                            | 2,24               | -                     | -                       | 8,07                                | 2,542 ↓                    | Brasil                         | 4,059 ↑   | Perú          | 3,323 ↓   |
| 52                            | -                  | -                     | -                       | 8,16 ↑                              | 2,846 ↓                    | Chile                          | 690,720 ↑ | Unión Europea | 0,8651 ↑  |
| Prime Rate                    |                    | 5,00                  |                         |                                     |                            |                                |           |               |           |
| Fed Funds                     |                    | 1,92                  |                         |                                     |                            |                                |           |               |           |

(m) Mercado Secundario.

(c) Respecto al dólar

Atentamente,

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