Información del 12-01-2018 al 15-01-2018

OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

TIPO DE CAMBIO		
Fecha	Compra	Venta
15/01/2018	6,86	6,96

UFV
2,23934

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

i. Vigente del 12/01/2017 al 16/01/2018

Valor	Moneda	Plazo en Días	Periodo de Protección (a)	Cantidad de Valores (b)	TR % (c)
LB-MN	MN	91	-	100.000	0,3984
LR-MN	MN	182	91	100.000	0,6000
BT 3,20%	MN	3.640	-	10.000	2,1000
BT 3,60%	MN	5.460	-	10.000	2,5900
BT 3,80%	MN	7.280	-	50.000	3,0188
BT 4,00%	MN	10.920	-	150.000	3,3301
BT 4,10%	MN	18.200	-	150.000	3,5011
BT 4,30%	MN	36.400	-	10.000	3,5870

a) En días, corresponde a los títulos con opcion de rescate anticipado. El periodo de proteccion se contabiliza a partir de la fecha de emision de los valores rescatables. Cuando la colocacion de estos valores se realice en dias posteriores a la fecha de emision, a traves 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 reportos vigentes

ii. Oferta diaria máxima de Reportos

(*) Vigente del 11/01/2018 al 17/01/2018

Moneda	Saldo Diario Disponible desde 23-10-14	Tasa Subasta (d)	TEA (e) Subasta	Tasa Mesa (f)	TEA e) Mesa	Plazo (En días) Máximo	Tasa de Valoración g)
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%

d) Tasa vigente del 11/01/2018 al 17/01/2018.

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

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

g) 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. Saldo vigente máximo para Reportos

(*) Vigente del 11/01/2018 al 17/01/2018

Moneda	Saldo Disponible Semanal	Tasa Subasta (d)	TEA (e) Subasta	Tasa Mesa (f)	TEA (e) Mesa	Plazo (En dias) Máximo
MN	3.000.000.000,00	2,50%	2,53%	3,00%	3,04%	15
ME	25.000.000,00	4,00%	4,08%	4,50%	4,60%	15

iv. Créditos con garantía del Fondo RAL (h)

Tramos	MN	TEA (i)	ME	TEA (i)
1er	4,00%	4,08%	5,50%	5,65%
2do	4,50%	4,60%	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. 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 03/2018

miércoles 17/01/2018 Apertura: Hrs.9:00 am.

Valor	Emisor	Cierre	Periodo de protección (j)	Moneda	Plazo (En días)	Modalidad	Cantidad
LB-MN	BCB	09:10	-	MN	91	Competitiva	300.000
LR-MN	BCB	09:20	91	MN	182	Competitiva	300.000
LR-MN	BCB	09:30	91	MN	273	Competitiva	200.000
LR-MN	BCB	09:40	91	MN	364	Competitiva	100.000
BT-MN 3,20%	TGN	09:10	-	MN	3.640	Competitiva	10.000
BT-MN 3,60%	TGN	09:20	-	MN	5.460	Competitiva	10.000
BT-MN 3,80%	TGN	09:30	-	MN	7.280	Competitiva	50.000
BT-MN 4,00%	TGN	09:40	-	MN	10.920	Competitiva	60.000
BT-MN 4,10%	TGN	09:50	-	MN	18.200	Competitiva	60.000
BT-MN 4,30%	TGN	10:00	-	MN	36.400	Competitiva	10.000

(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
08-ene	2,51%	2,51%	2,51%	10	20.000	2,40%	2,40%	2,40%	21	1.500
09-ene	-	-	-	-	-	2,40%	2,40%	2,40%	8	24.000
10-ene	2,35%	2,35%	2,35%	8	8.000	2,40%	2,40%	2,40%	7	1.000
11-ene	-	-	-	-	-	2,40%	2,40%	2,40%	13	9.000
12-ene	-	-	-	-	-	2,40%	2,40%	2,40%	13	7.000

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 EL RUEDO DE LA BOLSA BOLIVIANA DE VALORES - 12/01/2018

Instrumentos	Monto negociado (en dólares americanos)
Bonos Bancarios Bursátiles	
Bonos del Banco Central de Bolivia	
Bonos de Largo Plazo	
Bonos del Tesoro	175.591,84
Cupones de Bonos	2.057.325,07
Depósitos a Plazo Fijo	11.489.522,24
Letras del Banco Central de Bolivia	
Letras BCB Prepagables	
Pagarés Bursátiles	
Valores de Contenido Crediticio	
Total	13.722.439,15

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			3.00%			2.50%
		BME						3.50%
		BNB					2.00%	
		BSO					2.80%	2.80%
		BTB			2.50%			
		FEF		2.70%				
		FPR		3.00%	2.95%			3.00%
	BTS	TGN						3.00%
	CUP	TGN						2.50%

Fuente: BBV

IV MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO

Plazo semanas	EEUU 12-ene-2018	Arg $ 9-ene-2018	Chile $ 9-ene-2018	Méx MN(m) 12-ene-2018	Libor ($us) 12-ene-2018
4	1,28 ⇧	-	-	7,27	1,559
13	1,42 ⇧	27,00	-	7,39 ⇩	1,722 ⇧
26	1,56 ⇧	-	-	7,59 ⇩	1,888 ⇧
36	-	-	-	-	-
52	-	-	-	7,66 ⇩	2,173 ⇧
Prime Rate		4.50			
Fed Funds		1.42			

(m) Mercado Secundario

B. TIPOS DE CAMBIO

TIPO DE CAMBIO (e) al 12-ene-18			
Argentina	18,686 ⇩	Japón	111,040 ⇩
Reino Unido	0,728 ⇩	México	19,032 ⇩
Brasil	3,205 ⇩	Perú	3,217 ⇩
Chile	603,180 ⇩	Unión Europea	0,8210 ⇩

(e) Respecto al dólar

Atentamente,

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