



Información del 14-08-2018 al 15-08-2018

### OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

| TIPO DE CAMBIO |        |       | UFV     |
|----------------|--------|-------|---------|
| Fecha          | Compra | Venta |         |
| 15/08/2018     | 6,86   | 6,96  | 2,27741 |

#### I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

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

No existe oferta

##### B. OPERACIONES DE REPORTEO

###### i. Operaciones de Reporto vigentes

No existen operaciones Vigentes.

###### ii. Oferta diaria máxima de Reportos

(\*) Vigente del 09/08/2018 al 22/08/2018

| Moneda | Monto Diario<br>Disponible desde 23-10-14 | Tasa        | TEA (f) | Tasa     | TEA (f) | Plazo (En días)<br>Máximo | Tasa de<br>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 09/08/2018 al 22/08/2018.

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 34/2018 miércoles 22/08/2018 Apertura: Hrs.9:00 am.

| Valor       | Emisor | Cierre | Periodo de<br>protección (f) | 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 | 20.000   |
| BT-MN 3,80% | TGN    | 09:30  | -                            | MN     | 7.280           | Competitiva | 90.000   |
| BT-MN 4,00% | TGN    | 09:40  | -                            | MN     | 10.920          | Competitiva | 90.000   |
| BT-MN 4,10% | TGN    | 09:50  | -                            | MN     | 18.200          | Competitiva | 80.000   |

(f) 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 |       |            |             |       |
|-----------|--------------------|-------|------------|-------------|--------|-----------------------|-------|------------|-------------|-------|
|           | Min.               | Max.  | Prom. (**) |             |        | Min.                  | Max.  | Prom. (**) | Plazo Prom. | Monto |
| 08-ago    | -                  | -     | -          | -           | -      | 2,45%                 | 2,45% | 2,45%      | 7           | 3.000 |
| 09-ago    | 1,40%              | 1,40% | 1,40%      | 12          | 40.000 | 2,45%                 | 2,45% | 2,45%      | 7           | 3.000 |
| 10-ago    | -                  | -     | -          | -           | -      | 2,40%                 | 2,40% | 2,40%      | 21          | 2.000 |
| 13-ago    | -                  | -     | -          | -           | -      | 2,40%                 | 2,40% | 2,40%      | 21          | 900   |
| 14-ago    | -                  | -     | -          | -           | -      | 2,40%                 | 2,40% | 2,40%      | 7           | 2.000 |

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 -14/08/2018

| 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          | 484,11                                     | BS     | BEC     |   |        |         |         |         | 1,10%   |       |
| Bonos del Banco Central de Bolivia  |  |        | BGA     |   |        |         |         |         |         | 1,10% |
| Bonos de Largo Plazo                | 294.840,39                                 |        | BIS     | 1,10%   | 1,13%  |         | 1,09%   |         |         | 1,10% |
| Bonos Municipales                   | 760.501,03                                 |        | BME     |   | 1,80%  |         |         | 1,76%   |         |       |
| Bonos del Tesoro                    | 4.402.090,94                               |        | BSO     |   |        |         |         |         |         | 1,13% |
| Cuponos de Bonos                    |  |        | BTB     | 3,00%   | 1,13%  |         |         |         |         | 1,09% |
| Depósitos a Plazo Fijo              | 26.244.309,22                              |        | BUN     |   |        |         |         | 1,08%   |         |       |
| Letras del Banco Central de Bolivia |  |        | FCO     |   |        |         | 3,49%   |         |         |       |
| Letras BCB Prepagables              | 4.504.373,18                               |        | FPR     |   | 1,12%  |         |         |         | 1,09%   |       |
| Pagares Bursátiles                  |  |        | BBB     |   |        |         |         |         | 1,80%   |       |
| Valores de Contenido Crediticio     | 102.658,97                                 |        | BLP     |   |        |         |         | 1,80%   |         |       |
| <b>Total</b>                        | <b>36.309.257,84</b>                       |        | BMS     |   |        |         |         | 1,80%   | 1,80%   | 1,80% |
|                                     |  | BTS    |         |   |        |         |         | 1,20%   |         |       |
|                                     |  | LRS    |         |   |        |         | 0,50%   |         |         |       |
|                                     |  | VTD    |         |   |        |         | 1,70%   | 1,70%   | 1,70%   |       |

Fuente: BBV

## IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 14/08/2018

| Moneda               | Mercado Bursátil |         |         |       |       | Mercado Extrabursátil |       |     | Consolidado   |       |     |
|----------------------|------------------|---------|---------|-------|-------|-----------------------|-------|-----|---------------|-------|-----|
|                      | Prom. Ponderado  |         | Tasas   |       |       | Prom. Extrabursátil   | Tasas |     | Prom. General | Tasas |     |
|                      | CVT              | Reporto | General | Min   | Max   |                       | Min   | Max |               | Min   | Max |
| Plazos Hasta 45 Días |                  |         |         |       |       |                       |       |     |               |       |     |
| ME                   |                  |         |         |       |       |                       |       |     |               |       |     |
| MN                   |                  | 1,29%   | 1,29%   | 0,50% | 3,50% |                       |       |     |               |       |     |
| MV                   |                  |         |         |       |       |                       |       |     |               |       |     |

Fuente: BBV

## V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

| Plazo semanas | A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO |                       |                         |                          |                             | B. TIPOS DE CAMBIO              |           |               |           |
|---------------|-------------------------------|-----------------------|-------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------------------|-----------|---------------|-----------|
|               | EEUU<br>14-ago-2018           | Arg \$<br>14-ago-2018 | Chile \$<br>14-ago-2018 | Méx MN(m)<br>14-ago-2018 | Libor (\$us)<br>14-ago-2018 | TIPO DE CAMBIO (e) al 14-ago-18 |           |               |           |
| 4             | 1,94 ↑                        | 45,04 (n)             | -                       | 7,74 ↓                   | 2,064 ↑                     | Argentina                       | 29,714 ↓  | Japón         | 111,200 ↑ |
| 9             | -                             | 45,00                 | -                       | -                        | -                           | Reino Unido                     | 0,786 ↑   | México        | 18,876 ↓  |
| 13            | 2,03 ↑                        | 42,75 (e)             | -                       | 7,89 ↑                   | 2,315 ↑                     | Brasil                          | 3,863 ↓   | Perú          | 3,300 ↑   |
| 26            | 2,18 ↑                        | -                     | -                       | 8,02 ↑                   | 2,512 ↑                     | Chile                           | 665,010 ↑ | Unión Europea | 0,8815 ↑  |
| 52            | -                             | -                     | -                       | 8,15 ↓                   | 2,814 ↑                     |                                 |           |               |           |
| Prime Rate    |                               | 5,00                  |                         |                          |                             |                                 |           |               |           |
| Fed Funds     |                               | 1,91                  |                         |                          |                             |                                 |           |               |           |

(m) Mercado Secundario.

(n) Corresponde al plazo de 5 semanas.

(e) Corresponde al plazo de 14 semanas.

(e) Respecto al dólar

Atentamente,

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