



**OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO**

| TIPO DE CAMBIO |        |       | UFV     |
|----------------|--------|-------|---------|
| Fecha          | Compra | Venta |         |
| 17/02/2017     | 6,86   | 6,96  | 2,18373 |

**I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO**

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

i. Vigente del 17/02/2017 al 21/02/2017

No existe oferta

**B. OPERACIONES DE REPORTE**

i. Operaciones de Reporto vigentes

No existen operaciones Vigentes.

ii. Oferta diaria máxima de Reportos

(\*) Vigente del 16/02/2017 al 22/02/2017

| 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 16/02/2017 al 22/02/2017

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 reporte con colaterales en MN y ME. Para colaterales en UFV la tasa es 5,50%

iii. Saldo vigente máximo para Reportos

(\*) Vigente del 16/02/2017 al 22/02/2017

| Moneda | Saldo Disponible Semanal | Tasa Subasta (d) | TEA (e) Subasta | Tasa Mesa (f) | TEA (e) Mesa | Plazo (En días) Máximo |
|--------|--------------------------|------------------|-----------------|---------------|--------------|------------------------|
| MN     | 3.000.000.000            | 2,50%            | 2,53%           | 3,00%         | 3,04%        | 15                     |
| ME     | 25.000.000               | 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 BCE.

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 08/2017

miércoles 22/02/2017 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 | 100.000  |
| LR-MN       | BCB    | 09:20  | 91                        | MN     | 182             | Competitiva | 400.000  |
| LR-MN       | BCB    | 09:30  | 91                        | MN     | 273             | Competitiva | 300.000  |
| LR-MN       | BCB    | 09:40  | 91                        | MN     | 364             | Competitiva | 200.000  |
| 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 | 20.000   |
| BT-MN 4,00% | TGN    | 09:40  | -                         | MN     | 10.920          | Competitiva | 50.000   |
| BT-MN 4,10% | TGN    | 09:50  | -                         | MN     | 18.200          | Competitiva | 5.000    |
| BT-MN 4,30% | TGN    | 10:00  | -                         | MN     | 36.400          | Competitiva | 5.000    |

(j) 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 |
|-----------|--------------------|-------|------------|-------------|--------|-----------------------|-------|------------|-------------|-------|
|           | Min.               | Max.  | Prom. (**) |             |        | Min.                  | Max.  | Prom. (**) |             |       |
| 10-feb    | -                  | -     | -          | -           | -      | 1,00%                 | 1,00% | 1,00%      | 24          | 1.000 |
| 13-feb    | 1,00%              | 1,00% | 1,00%      | 12          | 55.000 | -                     | -     | -          | -           | -     |
| 14-feb    | 1,00%              | 1,00% | 1,00%      | 7           | 40.000 | 1,00%                 | 1,00% | 1,00%      | 12          | 3.600 |
| 15-feb    | 1,00%              | 1,00% | 1,00%      | 7           | 50.000 | -                     | -     | -          | -           | -     |
| 16-feb    | 1,00%              | 1,00% | 1,00%      | 14          | 61.000 | -                     | -     | -          | -           | -     |

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 - 16/02/2017

| 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          | 62.593,29                                  | BS     | BBB     |   |        |         |         | 1,70    |         |
| Bonos del Banco Central de Bolivia  |  |        | BLP     |   |        |         |         | 1,70    | 1,75    |
| Bonos de Largo Plazo                | 1.106.007,89                               |        |         |   |        |         |         |         |         |
| Bonos del Tesoro                    |  |        |         |   |        |         | 1,20    |         |         |
| Cupones de Bonos                    |  |        |         |   |        |         |         | 1,20    |         |
| Depósitos a Plazo Fijo              | 25.973.171,73                              |        |         |   |        |         |         | 1,50    | 1,50    |
| Letras del Banco Central de Bolivia |  |        |         |   | 1,30   |         |         | 1,39    |         |
| Letras BCB Prepagables              | 1.589.067,06                               |        |         |   |        |         |         | 1,20    |         |
| Pagarés Bursátiles                  |  |        |         |   | 1,50   |         |         |         |         |
| Valores de Contenido Crediticio     |  |        |         |   |        |         |         |         | 1,10    |
| <b>Total</b>                        | <b>28.730.839,97</b>                       |        |         |   |        |         |         | 1,30    | 1,48    |
|                                     | Fuente: BBV                                |        |         |   |        | 1,40    |         |         | 1,22    |
|                                     |  | USD    | BLP     |   |        |         |         |         | 0,25    |
|                                     |  |        | DPF     |   |        |         |         |         | 0,25    |
|                                     |  |        | BNB     |   |        |         |         |         | 0,18    |

Fuente: BBV

### IV MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

| Plazo<br>semanas  | A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO |                           |                         |                                      |                             |
|-------------------|-------------------------------|---------------------------|-------------------------|--------------------------------------|-----------------------------|
|                   | EEUU<br>16-feb-2017           | Arg \$ (*)<br>14-feb-2017 | Chile \$<br>14-feb-2017 | Méx MN <sup>(m)</sup><br>16-feb-2017 | Libor (\$us)<br>16-feb-2017 |
| 4                 | 0,50                          | 23,75                     | 3,23                    | 6,21 ↑                               | 0,781 ↑                     |
| 13                | 0,51 ↓                        | 22,00                     | -                       | 6,40 ↑                               | 1,057 ↑                     |
| 26                | 0,64 ↓                        | -                         | -                       | 6,67 ↓                               | 1,364 ↑                     |
| 36                | -                             | 21,25                     | -                       | -                                    | -                           |
| 52                | -                             | -                         | -                       | 6,90                                 | 1,745 ↑                     |
| 104               | -                             | -                         | -                       | -                                    | -                           |
| <b>Prime Rate</b> |                               | <b>3,75</b>               |                         |                                      |                             |
| <b>Fed Funds</b>  |                               | <b>0,66</b>               |                         |                                      |                             |

(m) Mercado Secundario

(\*) En Argentina (última adjudicación), las TR corresponden: a 4, 13 y 31 semanas.

| B. TIPOS DE CAMBIO              |           |               |           |
|---------------------------------|-----------|---------------|-----------|
| TIPO DE CAMBIO (e) al 16-feb-17 |           |               |           |
| Argentina                       | 15,427 ↑  | Japón         | 113,200 ↓ |
| Reino Unido                     | 0,801 ↓   | México        | 20,310 ↑  |
| Brasil                          | 3,086 ↑   | Perú          | 3,249 ↑   |
| Chile                           | 638,760 ↓ | Unión Europea | 0,9372 ↓  |

(e) Respecto al dólar

Atentamente,

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