

OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

TIPO DE CAMBIO			UFV
Fecha	Compra	Venta	
20/10/21	6,86	6,96	

2,37024

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

i. Vigente del 15/10/2021 al 19/10/2021

Oferta agotada en la sesión de fecha 15/10/2020

B. OPERACIONES DE REPORTO

i. Operaciones de Reporto vigentes

No existen operaciones de reporto vigentes

ii. Oferta diaria de Reportos

i. Vigente del 14/10/2021 al 20/10/2021

Para Valores Públicos y Valores de Emisores Privados (DPF)

Moneda	Monto Diario	Tasa	TEA (e)	Tasa	TEA (e)	Plazo (En días)	Tasa de
	Disponible desde 12-06-20	Subasta (d)	Subasta	Mesa (f)	Mesa	Máximo	Valoración (g)
MN	250.000.000	6,00%	6,15%	6,50%	6,68%	60	11,00%
ME	5.000.000	6,50%	6,71%	7,00%	7,24%	15	15,00%

d) Tasa vigente del 14/10/2021 al 20/10/2021.

e) TEA referencial calculada para un plazo de 60 días (MN) y 15 días (ME).

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

g) Tasa para determinar el Valor de Ida en una operación de reporto. Para MN con valores de emisores privados: DPF AAA (12,50%), DPF AA1 (13,00%), DPF AA2 (13,70%), DPF AA3 (14,60%) y DPF A1 (15,70%). Para MN-UFV la tasa es 9,00%

iii. Tasas para Créditos con garantía del Fondo RAL (h)

Tramos	MN	TEA (i)	ME	TEA (i)
1er	8,00%	8,32%	8,50%	8,86%
2do	8,50%	8,86%	9,00%	9,41%

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

i) TEA calculada para un plazo de 7 días.

C. OFERTA DE VALORES EN SUBASTA

i. Subasta Electrónica de Valores Públicos de la semana 42/2021

miércoles 20/10/2021 Apertura: Hrs.9:00 am.

	Emisor	Cierre	Periodo de protección (j)	Moneda	Plazo (En días)	Modalidad	Cantidad de Títulos(k)
LR-MN	BCB	09:20	91	MN	273	Competitiva	20.000
BT-MN 4,80%	TGN	09:30	-	MN	7.280	Competitiva	200.000
BT-MN 5,00%	TGN	09:40	-	MN	10.920	Competitiva	200.000
BT-MN 5,10%	TGN	09:50	-	MN	18.200	Competitiva	200.000

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

(k) Cada título tiene un valor nominal de 1.000 unidades en moneda origen.

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
13-oct	4,50%	4,50%	4,50%	15	30.000	-	-	-	-	-
14-oct	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
15-oct	4,50%	4,50%	4,50%	7	40.000	-	-	-	-	-
18-oct	4,50%	6,00%	4,86%	8	57.000	-	-	-	-	-
19-oct	8,00%	8,00%	8,00%	20	6.860	-	-	-	-	-

Operaciones interbancarias realizadas por sondeo. Datos Preliminares.
 (*) Operaciones reportadas por el subsector financiero al Banco Central de Bolivia (BCB).

(**) Promedio Ponderado por monto y plazo.

III. OPERACIONES DE REPORTO REALIZADAS EN LA BOLSA BOLIVIANA DE VALORES 19/10/2021

Instrumentos	Monto negociado (en dólares americanos)
Bonos Bancarios Bursátiles	188.081,54
Bonos del Banco Central de Bolivia	
Bonos de Largo Plazo	300.000,00
Bonos Municipales	
Bonos del Tesoro	2.505.788,54
Cupones de Bonos	
Letras del Tesoro	
Depósitos a Plazo Fijo	32.368.073,71
Letras del Banco Central de Bolivia	
Letras BCB Prepagables	
Pagarés Bursátiles	
Valores de Contenido Crediticio	722.068,29
Total	36.084.012,08

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	BGA			1,25%			3,23%
		BIS		1,13%			1,24%	
		BME			1,60%		1,53%	1,98%
		BNB						2,00%
		BSO			1,79%			2,00%
		BTB				1,36%	1,60%	
		BUN					1,74%	
		FFO						1,66%
		FIE						1,72%
		FPR						8,00%
	NFB						2,00%	
	BBB	BNB				2,00%		
FEF							3,50%	
	ETS	TCN					2,50%	
	VTD	PMA			4,80%			
	DPF	BNB	0,10%					
USD	BBB	BNB	0,10%					
	BLP	TSM			1,80%			

Fuente:BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 19/10/2021

Mercado Bursátil					
Moneda	CVT	Reporto	General	Min	Max
Plazos Hasta 45 Días					
MN		1,90%	1,90%	1,00%	8,00%
MU					
ME		0,10%	0,10%	0,10%	0,10%
MY					
MV					

Fuente:BBV

V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO					
Plazo semanas	EEUU 19-oct.-2021	Arg \$ 18-oct.-2021	Chile \$ 18-oct.-2021	Méx MN(s) 19-oct.-2021	Libor (\$us) 19-oct.-2021
4	0,04	-	2,75	4,84 ↓	0,09
13	0,04	-	-	5,29 ↑	0,13
26	0,05	-	-	5,70 ↑	0,17
52	-	-	-	6,20 ↑	0,29 ↓
Prime Rate		3,25			
Fed Funds		0,08			

(k) Mercado Secundario.

B. TIPOS DE CAMBIO			
TIPO DE CAMBIO (l) al		19-oct.-2021	
Argentina	99,31 ↑	Japón	114,32 ↑
Reino Unido	0,72 ↓	México	20,26 ↓
Brasil	5,61 ↑	Perú	3,95
Chile	811,24 ↓	Unión Europea	0,86

(l) Respecto al dólar

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