



Información del 20-01-2020 al 21-01-2020

OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

TIPO DE CAMBIO			UFV
Fecha	Compra	Venta	
21/01/2020	6,86	6,96	

2,33496

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

No existe oferta

B. OPERACIONES DE REPORTO

i. Operaciones de Reporto vigentes

Moneda	F. Operación	T. Premio %	Monto	Plazo en días	F. Vencimiento
MN	10/12/2019	3,01	18.100.474,72	45	24/01/2020
MN	11/12/2019	3,00	6.151.927,65	43	23/01/2020
MN	12/12/2019	3,00	2.604.629,17	43	24/01/2020
MN	12/12/2019	3,00	10.566.298,00	43	24/01/2020
MN	17/12/2019	3,00	15.949.663,78	43	29/01/2020
MN	18/12/2019	3,05	76.229.008,10	44	31/01/2020
MN	18/12/2019	3,01	15.208.962,30	34	21/01/2020
MN	18/12/2019	3,00	9.757.166,64	43	30/01/2020
MN	18/12/2019	3,00	31.611.772,37	43	30/01/2020
MN	18/12/2019	3,00	10.183.485,32	36	23/01/2020
MN	19/12/2019	3,00	15.290.648,00	43	31/01/2020
MN	20/12/2019	3,00	15.042.362,60	45	03/02/2020
MN	20/12/2019	3,00	32.774.200,00	45	03/02/2020
MN	23/12/2019	3,00	12.169.477,50	43	04/02/2020
MN	23/12/2019	3,01	5.384.099,61	45	06/02/2020
MN	24/12/2019	3,00	12.247.680,28	41	03/02/2020
MN	24/12/2019	3,00	6.654.853,80	45	07/02/2020
MN	24/12/2019	3,00	1.515.692,57	45	07/02/2020
MN	24/12/2019	3,00	11.946.169,64	45	07/02/2020
MN	26/12/2019	3,00	7.780.944,98	42	06/02/2020
MN	27/12/2019	3,50	106.983.040,88	45	10/02/2020
MN	27/12/2019	3,05	8.994.396,12	45	10/02/2020
MN	27/12/2019	3,05	9.243.399,42	38	03/02/2020
MN	27/12/2019	3,00	5.304.170,92	42	07/02/2020
MN	27/12/2019	3,00	9.076.519,80	45	10/02/2020
MN	27/12/2019	3,00	1.728.551,43	45	10/02/2020
MN	27/12/2019	3,00	1.544.904,31	41	06/02/2020
MN	30/12/2019	3,06	17.145.865,26	45	13/02/2020
MN	30/12/2019	3,06	20.317.400,51	39	07/02/2020
MN	30/12/2019	3,05	10.500.000,00	45	13/02/2020
MN	31/12/2019	3,00	3.598.586,02	45	14/02/2020
MN	02/01/2020	3,00	4.478.505,70	43	14/02/2020
MN	02/01/2020	3,00	1.795.469,26	43	14/02/2020
MN	02/01/2020	3,00	3.895.082,96	43	14/02/2020
MN	06/01/2020	3,00	32.130.319,82	45	20/02/2020
MN	07/01/2020	3,00	4.283.269,52	44	20/02/2020
MN	07/01/2020	3,00	4.246.763,42	45	21/02/2020
MN	07/01/2020	3,00	4.901.886,80	45	21/02/2020
MN	07/01/2020	3,00	2.331.749,26	45	21/02/2020
MN	07/01/2020	3,00	3.601.840,72	45	21/02/2020
MN	07/01/2020	3,00	4.122.890,41	38	14/02/2020
MN	09/01/2020	3,00	26.692.328,34	43	21/02/2020
MN	09/01/2020	3,00	4.300.132,83	43	21/02/2020
MN	10/01/2020	3,00	35.511.417,23	42	21/02/2020
MN	13/01/2020	3,00	2.893.910,00	37	19/02/2020
MN	14/01/2020	3,00	4.054.648,49	45	28/02/2020
MN	14/01/2020	3,00	10.861.400,00	45	28/02/2020
MN	15/01/2020	3,00	1.991.660,57	37	21/02/2020
MN	16/01/2020	3,02	142.721.115,60	43	28/02/2020
MN	16/01/2020	3,00	4.733.151,47	29	14/02/2020
MN	17/01/2020	3,05	65.770.686,73	45	02/03/2020
MN	17/01/2020	3,03	3.099.876,34	45	02/03/2020
MN	17/01/2020	3,03	74.056.934,97	45	02/03/2020
MN	17/01/2020	3,00	5.176.080,32	45	02/03/2020
MN	17/01/2020	3,03	1.028.888,68	28	14/02/2020
MN	20/01/2020	3,00	9.122.574,54	45	05/03/2020
Total Vigente Bs			969.368.955,68		

ii. Oferta diaria máxima de Reportos

(*) Vigente del 09/01/2020 al 23/01/2020

Para Valores Públicos y Valores de Emisores Privados (DPF)

Moneda	Monto Diario	Tasa	TEA (f)	Tasa	TEA (f)	Plazo (En días)	Tasa de
	Disponible desde 7-11-19	Subasta (e)	Subasta	Mesa (g)	Mesa	Máximo	Valoración (h)
MN	150.000.000	3,00%	3,04%	3,50%	3,55%	45	8,00%
ME	5.000.000	4,00%	4,08%	4,50%	4,60%	15	12,50%

e) Tasa vigente del 09/01/2020 al 23/01/2020.

f) TEA referencial calculada para un plazo de 45 días (MN) y 15 días (ME).

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

h) Tasa utilizada para determinar el Valor de Ida en una operación de reporto. Para MN con valores de emisores privados: DPF AAA (9,50%) y DPF AA+ (10,00%). Para MN-UFV la tasa es 6,00%

iii. Saldo vigente máximo para Reportos

(*) Vigente del 09/01/2020 al 23/01/2020

Moneda	Monto Disponible Semanal	Tasa Subasta (d)	TEA (e)	Tasa Mesa (f*)	TEA (e)	Plazo (En días)
			Subasta		Mesa	Máximo
MN	750.000.000,00	3,00%	3,04%	3,50%	3,55%	45
ME	25.000.000,00	4,00%	4,08%	4,50%	4,60%	15

e) TEA referencial calculada para un plazo de 45 días (MN) y 15 días (ME).

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

iii. Créditos con garantía del Fondo RAL (i)

Tramos	MN	TEA (j)	ME	TEA (j)
1er	3,50%	3,56%	5,50%	5,65%
2do	4,00%	4,08%	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 04/2020
jueves 23/01/2020 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
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

(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
14-ene	7,50%	7,50%	7,50%	7	20.000	2,80%	2,80%	2,80%	3	4.000
15-ene	7,00%	7,00%	7,00%	5	15.000	-	-	-	-	-
16-ene	7,00%	7,00%	7,00%	12	25.000	-	-	-	-	-
17-ene	7,00%	7,00%	7,00%	23	90.000	2,80%	2,80%	2,80%	7	5.000
20-ene	7,00%	7,00%	7,00%	7	100.000	-	-	-	-	-

Operaciones interbancarias realizadas por sondeos. 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 20/01/2020

Instrumentos	Monto negociado (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	812.403,02	BS	BEC			4,50%		5,00%	
Bonos del Banco Central de Bolivia			BGA				4,50%		5,00%
Bonos de Largo Plazo	500.381,55		BIS	4,45%					4,93%
Bonos Municipales			BNB	4,40%				5,00%	5,00%
Bonos del Tesoro			BSO				4,49%	4,50%	
Cupones de Bonos	762.095,19		FCO						6,00%
Depósitos a Plazo Fijo	13.202.642,64		FEF				5,00%		
Letras del Banco Central de Bolivia			FFO				5,05%		5,00%
Letras BCB Prepagables			FIE				4,49%		
Pagorés Bursátiles			BEC				4,00%		
Valores de Contenido Crediticio			BNB						5,00%
Total	15.277.522,39		BSO						4,96%
Fuente: BBV			DIN				5,00%	5,00%	5,00%
			SBC				5,00%		5,00%
			TGN						4,00%
			BNB						0,70%
			FCO				1,05%		
			CAI						0,70%
		TRA				0,70%		0,70%	

Fuente: BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 20/01/2020

Moneda	Mercado Bursátil					Mercado Extrabursátil			Consolidado		
	Prom. Ponderado		Tasas			Prom.	Tasas		Prom.	Tasas	
	CVT	Reporto	General	Min	Max	Extrabursátil	Min	Max	General	Min	Max
Plazos Hasta 45 Días											
ME		0,75%	0,75%	0,70%	1,05%						
MN		4,83%	4,83%	4,00%	5,99%						
MV											

Fuente: BBV

V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO						B. TIPOS DE CAMBIO			
Plazo semanas	EEUU 20-ene-2020	Arg \$ 10-ene-2020	Chile \$ 10-ene-2020	Méx MN _(m) 20-ene-2020	Libor (\$us) 20-ene-2020	TIPO DE CAMBIO (c) al 20-ene-2020			
4	1,53	-	1,64	7,17	1,653	Argentina	60,003	Japón	110,170
13	1,52	-	-	7,15	1,802	Reino Unido	0,769	México	18,668
26	1,52	-	-	7,10	1,830	Brasil	4,189	Perú	3,317
52	-	-	-	7,05	1,925	Chile	769,510	Unión Europea	0,9014
Prime Rate	4,75								
Fed Funds	1,54								

(m) Mercado Secundario.

(c) Respecto al dólar

Atentamente,

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