

OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

TIPO DE CAMBIO			UFV
Fecha	Compra	Venta	
21/10/21	6,86	6,96	2,37030

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

i. Vigente del 22/10/2021 al 26/10/2021

Valor	TR Descuento (%)	Moneda	Plazo en días (*)	Periodo de protección (a)	Cantidad de valores (b)	TR Efect. % (c)
BT	5,1000	MN	18,200	-	45.000	5,1000
						Total Bs 45.000

a) En días, corresponde a los títulos con opción de rescate anticipado. El periodo de protección se contabiliza a partir de la fecha de emisión de los valores recabables. Cuando la colocación de estos valores se realice en días posteriores a la fecha de emisión, a través 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 operaciones de reporto vigentes

ii. Oferta diaria de Reportos

i. Vigente del 21/10/2021 al 27/10/2021

Para Valores Públicos y Valores de Emisores Privados (DPF)

Moneda	Monto Diario Disponible desde 12-06-20	Tasa Subasta (d)	TEA (e)	Tasa Subasta	TEA (e)	Plazo (En días) Mesa	Tasa de 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 21/10/2021 al 27/10/2021.

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 43/2021

miércoles 27/10/2021 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

Fecha al:	Min.	Max.	Prom. (**)	Plazo Prom.	Monto	Min.	Max.	Prom. (**)	Plazo Prom.	Monto
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	-	-	-	-	-
20-oct	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Operaciones interbancarias realizadas por sondeo. Datos Preliminares.

(*) Incluye operaciones de Entidades Financieras de Vivienda entre otras (IFD).

(**) Promedio Ponderado por monto y plazo.

III. OPERACIONES DE REPORTO REALIZADAS EN LA BOLSA BOLIVIANA DE VALORES 20/10/2021

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			BEC						1,30%
Bonos del Banco Central de Bolivia			BGA						1,30%
Bonos de Largo Plazo	76.545,00		BME	1,60%					1,30%
Bonos Municipales			BNB	0,80%	1,40%				1,55%
Bonos del Tesoro	3.967.473,43		BSO	0,80%					1,70%
Cupones de Bonos	2.251.744,11		BTB						1,44%
Letras del Tesoro			BUN						1,35%
Depósitos a Plazo Fijo	20.762.906,29		FFO						1,33%
Letras del Banco Central de Bolivia			FIE	1,00%					1,50%
Letras BCB Prepagables			TGN						1,50%
Pagarés Bursátiles			CUP						3,00%
Valores de Contenido Crediticio	112.643,17		TGN						4,00%
Total	27.171.312,00		VTD						2,70%
			PCI						4,00%
			BLP						4,76%
			BNL						0,60%

Fuente: BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 20/10/2021

Moneda	Mercado Bursátil				
	CVT	Reporto	General	Min	Max
Plazos Hasta 45 Días					
MN		1,40%	1,40%	0,80%	2,00%
MU					
ME					
MY					
MV					

Fuente: BBV

V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO					
Plazo	EEUU	Arg \$	Chile \$	Méx MN ^(k)	Libor (\$us)
semanas	20-oct-2021	20-oct-2021	20-oct-2021	20-oct-2021	20-oct-2021
4	0,04	-	2,75	4,83 	0,09
13	0,04	-	3,38	5,31 	0,13
26	0,05	-	-	5,70	0,17
52	-	-	-	6,17 	0,30 
Prime Rate		3,25			
Fed Funds		0,08			

(k) Mercado Secundario.

B. TIPOS DE CAMBIO				
	TIPO DE CAMBIO (I) al	20-oct-2021		
Argentina	99,35 		Japón	114,24 
Reino Unido	0,72		México	20,18 
Brasil	5,54 		Perú	3,94 
Chile	813,35 		Unión Europea	0,86

(I) Respecto al dólar

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