



Información del 21-09-2020 al 22-09-2020

OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

| TIPO DE CAMBIO | | | UPV |
|----------------|--------|-------|---------|
| Fecha | Compra | Venta | |
| 22/09/2020 | 6,86 | 6,96 | 2,35683 |

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO

i. Vigente del 18/09/2020 al 22/09/2020

| Valor | TR Nominal (%) | Moneda | Plazo en días (*) | Periodo de protección (s) | Cantidad de valores (b) | TR Efect. % (c) |
|-----------------|----------------|--------|-------------------|---------------------------|-------------------------|-----------------|
| BT | 4,1000 | MN | 5,460 | - | 150.000 | 4,1000 |
| BT | 4,8000 | MN | 7,280 | - | 150.000 | 4,8000 |
| BT | 5,0000 | MN | 10,920 | - | 125.000 | 5,0000 |
| BT | 5,1000 | MN | 18,200 | - | 125.000 | 5,1000 |
| Total Bs | | | | | 550.000 | |

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 rescatables. 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.

ii. COLOCACIONES EN MESA DE DINERO DE LA SEMANA 38/2020 del 18/09/2020 al 21/09/2020

| Valor | TR Nominal (%) | Moneda | Plazo en días (a) | Fecha Colocación | Cantidad de valores (b) | TR Efect. % (c) |
|-----------------|----------------|--------|-------------------|------------------|-------------------------|-----------------|
| BTNC15602038 | 5,0000 | MN | 10,920 | 18/09/2020 | 25,000 | 5,0000 |
| BTNC26002038 | 5,1000 | MN | 18,200 | 18/09/2020 | 25,000 | 5,1000 |
| Total Bs | | | | | 50.000 | |

a) Plazo de Emisión

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

c) Tasa de rendimiento efectiva.

B. OPERACIONES DE REPORTE

i. Operaciones de Reporto vigentes

| Moneda | F. Operación | T. Premio % | Monto | Plazo en días | F. Vencimiento |
|----------------------|--------------|-------------|-----------------------|---------------|----------------|
| MN | 28/07/2020 | 2,75 | 6.969.792,67 | 59 | 25/09/2020 |
| MN | 28/07/2020 | 2,75 | 11.242.600,00 | 57 | 23/09/2020 |
| MN | 29/07/2020 | 2,75 | 4.966.944,82 | 58 | 25/09/2020 |
| MN | 04/08/2020 | 2,75 | 15.008.433,99 | 59 | 02/10/2020 |
| MN | 05/08/2020 | 2,75 | 11.905.252,70 | 57 | 01/10/2020 |
| MN | 10/08/2020 | 2,75 | 18.012.598,78 | 60 | 09/10/2020 |
| MN | 11/08/2020 | 2,75 | 19.037.700,36 | 58 | 08/10/2020 |
| MN | 11/08/2020 | 2,75 | 3.745.014,58 | 45 | 25/09/2020 |
| MN | 13/08/2020 | 2,75 | 17.965.468,58 | 60 | 12/10/2020 |
| MN | 14/08/2020 | 2,75 | 2.959.160,81 | 56 | 09/10/2020 |
| MN | 14/08/2020 | 2,75 | 3.774.307,64 | 60 | 13/10/2020 |
| MN | 14/08/2020 | 2,75 | 19.322.733,52 | 60 | 13/10/2020 |
| MN | 14/08/2020 | 2,75 | 1.271.975,96 | 60 | 13/10/2020 |
| MN | 14/08/2020 | 2,75 | 7.627.156,36 | 60 | 13/10/2020 |
| MN | 14/08/2020 | 2,75 | 5.392.016,18 | 60 | 13/10/2020 |
| MN | 17/08/2020 | 2,75 | 6.743.680,84 | 60 | 16/10/2020 |
| MN | 17/08/2020 | 2,75 | 4.996.533,63 | 45 | 01/10/2020 |
| MN | 18/08/2020 | 2,75 | 29.011.600,00 | 59 | 16/10/2020 |
| MN | 18/08/2020 | 2,75 | 6.046.115,32 | 59 | 16/10/2020 |
| MN | 19/08/2020 | 2,75 | 15.184.434,75 | 58 | 16/10/2020 |
| MN | 21/8/2020 | 2,75 | 12.604.511,13 | 45 | 5/10/2020 |
| MN | 21/8/2020 | 2,75 | 18.041.000,00 | 59 | 19/10/2020 |
| MN | 21/8/2020 | 2,75 | 28.415.400,00 | 60 | 20/10/2020 |
| MN | 21/8/2020 | 2,75 | 2.777.422,56 | 60 | 20/10/2020 |
| MN | 21/8/2020 | 2,75 | 2.808.316,47 | 60 | 20/10/2020 |
| MN | 21/8/2020 | 2,75 | 6.310.556,36 | 60 | 20/10/2020 |
| MN | 21/8/2020 | 3,25 | 22.572.413,74 | 49 | 9/10/2020 |
| MN | 24/08/2020 | 2,75 | 4.931.125,69 | 60 | 23/10/2020 |
| MN | 25/08/2020 | 2,75 | 57.518.140,00 | 58 | 22/10/2020 |
| MN | 25/08/2020 | 2,75 | 3.932.966,92 | 45 | 09/10/2020 |
| MN | 25/08/2020 | 2,75 | 44.252.100,00 | 60 | 21/10/2020 |
| MN | 28/08/2020 | 2,75 | 9.747.122,88 | 60 | 27/10/2020 |
| MN | 28/08/2020 | 2,75 | 7.323.000,00 | 60 | 27/10/2020 |
| MN | 01/09/2020 | 2,75 | 8.186.825,58 | 59 | 30/10/2020 |
| MN | 02/09/2020 | 2,75 | 28.956.695,30 | 57 | 29/10/2020 |
| MN | 03/09/2020 | 2,75 | 16.956.310,52 | 56 | 29/10/2020 |
| MN | 04/09/2020 | 2,75 | 16.779.561,76 | 60 | 03/11/2020 |
| MN | 04/09/2020 | 2,75 | 28.969.243,46 | 60 | 03/11/2020 |
| MN | 07/09/2020 | 2,75 | 8.426.905,19 | 60 | 06/11/2020 |
| MN | 08/09/2020 | 2,75 | 28.996.458,10 | 58 | 05/11/2020 |
| MN | 11/09/2020 | 2,00 | 27.271.084,96 | 60 | 10/11/2020 |
| MN | 11/09/2020 | 2,00 | 12.296.200,00 | 60 | 10/11/2020 |
| MN | 15/09/2020 | 2,00 | 16.187.131,73 | 45 | 30/10/2020 |
| MN | 21/09/2020 | 2,00 | 18.169.221,84 | 60 | 20/11/2020 |
| MN | 21/09/2020 | 2,00 | 19.337.795,49 | 50 | 10/11/2020 |
| Total Vigente | | | 662.949.991,17 | | |

ii. Oferta diaria de Reportos

(*) Vigente del 17/09/2020 al 23/09/2020

Para Valores Públicos y Valores de Emisores Privados (DPF)

| Moneda | Monto Diario Disponible desde 12-06-20 | Tasa | TEA (e) | Tasa | TEA (e) | Plazo (En días) Máximo | Tasa de Valoración (g) |
|--------|--|-------------|---------|----------|---------|------------------------|------------------------|
| | | Subasta (d) | Subasta | Mesa (f) | Mesa | | |
| MN | 250.000.000 | 2,00% | 2,02% | 2,50% | 2,53% | 60 | 7,00% |
| ME | 5.000.000 | 4,00% | 4,08% | 4,50% | 4,60% | 15 | 12,50% |

d) Tasa vigente del 17/09/2020 al 23/09/2020.

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 Ísa en una operación de reporte. Para MN con valores de emisores privados: DPF AAA (8,50%), DPF AA1 (9,60%), DPF AA2 (9,70%), DPF AA3 (10,60%) y DPF A(11,70). Para MN-UPV la tasa es 5,00%.

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

| Tramos | MN | TEA (i) | ME | TEA (i) |
|--------|-------|---------|-------|---------|
| 1er | 2,50% | 2,53% | 5,50% | 5,65% |
| 2do | 3,00% | 3,04% | 6,00% | 6,18% |

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

3) TEA calculada para un plazo de 7 días.

C. OFERTA DE VALORES EN SUBASTA

i. Subasta Electrónica de Valores Públicos de la semana 39/2020
miércoles 23/09/2020 Apertura: Hrs.9:00 am.

| Valor | Emisor | Cierre | Periodo de protección (j) | Moneda | Plazo (En días) | Modalidad | Cantidad de Títulos(k) |
|-------------|--------|--------|---------------------------|--------|-----------------|-------------|------------------------|
| LB-MN | BCB | 09:10 | - | MN | 91 | Competitiva | 20.000 |
| BT-MN 3,70% | TGN | 09:10 | - | MN | 3.640 | Competitiva | 120.000 |
| BT-MN 4,10% | TGN | 09:20 | - | MN | 5.460 | Competitiva | 120.000 |
| BT-MN 4,80% | TGN | 09:30 | - | MN | 7.280 | Competitiva | 120.000 |
| BT-MN 5,00% | TGN | 09:40 | - | MN | 10.920 | Competitiva | 120.000 |
| BT-MN 5,10% | TGN | 09:50 | - | MN | 18.200 | Competitiva | 120.000 |

(j) En días, correspondiente a los límites 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 |
| 15-sep | 4,50% | 4,50% | 4,50% | 7 | 70.000 | 2,80% | 2,80% | 2,80% | 4 | 11.500 |
| 16-sep | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 17-sep | - | - | - | - | - | 2,80% | 2,80% | 2,80% | 5 | 10.000 |
| 18-sep | - | - | - | - | - | 2,80% | 2,80% | 2,80% | 9 | 15.000 |
| 21-sep | - | - | - | - | - | 2,80% | 2,80% | 2,80% | 7 | 4.000 |

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 LA BOLSA BOLIVIANA DE VALORES 21/09/2020

| 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 | 241.142,42 | BS | BGA | | | | 3,50% | | |
| Bonos del Banco Central de Bolivia | | | BIS | | | | 2,60% | 2,80% | |
| Bonos de Largo Plazo | 31.530,61 | | BME | | | | 4,00% | 3,00% | |
| Bonos Municipales | | | BNB | | | | | | 3,53% |
| Bonos del Tesoro | | | BSO | | | | 2,60% | | |
| Cupones de Bonos | | | BTB | | 2,80% | 3,00% | | | |
| Depósitos a Plazo Fijo | 20.278.707,97 | | BUN | | | | | | 3,00% |
| Letras del Banco Central de Bolivia | | | FEF | | | 3,90% | | | |
| Letras BCB Prepagables | | | FFO | | | | 3,89% | | |
| Pagarés Bursátiles | | | FIE | | | | 2,60% | 2,80% | |
| Valores de Contenido Crediticio | 386.865,58 | NFB | | 3,10% | | | | | |
| Total | 20.938.246,58 | BBB | | | | 3,50% | | | |
| | | BSO | | | | 3,50% | | | |
| | | BLP | | | | | | 3,90% | |
| | | CRP | | | | | | 7,70% | |
| | | VTD | | | | | | 5,25% | |
| | | PCI | | | | | 5,25% | | |

Fuente: BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 21/09/2020

| Moneda | Mercado Bursátil | | | |
|----------------------|------------------|---------|---------|-------------|
| | CVT | Reporto | General | Min Max |
| Plazos Hasta 45 Días | | | | |
| MN | 3,00% | 3,07% | 3,07% | 2,60% 4,45% |
| MU | | | | |
| ME | | | | |
| MY | | | | |
| MV | | | | |

Fuente: BBV

V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

| A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO | | | | | | B. TIPOS DE CAMBIO | | | |
|-------------------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------------|-----------|---------------|-----------|
| Plazo semanas | EEUU 21-sep-2020 | Arg \$ 15-sep-2020 | Chile \$ 15-sep-2020 | Méx MN(\$) 21-sep-2020 | Libor (\$us) 21-sep-2020 | TIPO DE CAMBIO (i) al 21-sep-2020 | | | |
| 4 | 0,08 | - | - | 4,37 | 0,152 ↓ | Argentina | 75,583 ↑ | Japón | 104,800 ↑ |
| 13 | 0,08 | - | - | 4,35 ↑ | 0,223 ↓ | Reino Unido | 0,782 ↑ | México | 21,405 ↑ |
| 26 | 0,10 ↓ | - | - | 4,36 ↑ | 0,273 ↓ | Brasil | 5,406 ↓ | Perú | 3,551 ↑ |
| 52 | - | - | - | 4,42 ↑ | 0,379 ↑ | Chile | 773,500 ↑ | Unión Europea | 0,8507 ↑ |
| Prime Rate | | 3,25 | | | | | | | |
| Fed Funds | | 0,09 | | | | | | | |

(k) Mercado Secundario.

(i) Respecto al dólar

Atentamente,

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