



Información del 27-03-2020 al 30-03-2020

**OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO**

| TIPO DE CAMBIO |        |       | UFV     |
|----------------|--------|-------|---------|
| Fecha          | Compra | Venta |         |
| 30/03/2020     | 6,86   | 6,96  | 2,34078 |

**I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO**

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

No existe oferta

**B. OPERACIONES DE REPORTE**

**i. Operaciones de Reporto vigentes**

| Moneda                  | F. Operación | T. Premio % | Monto                 | Plazo en días | F. Vencimiento |
|-------------------------|--------------|-------------|-----------------------|---------------|----------------|
| MN                      | 21/02/2020   | 3,00        | 27.869.182,10         | 45            | 06/04/2020     |
| MN                      | 21/02/2020   | 2,75        | 4.368.536,14          | 45            | 06/04/2020     |
| MN                      | 27/02/2020   | 2,75        | 1.911.889,54          | 42            | 09/04/2020     |
| MN                      | 28/02/2020   | 3,10        | 11.315.800,00         | 45            | 13/04/2020     |
| MN                      | 28/02/2020   | 2,75        | 5.274.202,22          | 40            | 08/04/2020     |
| MN                      | 02/03/2020   | 2,75        | 1.021.392,35          | 45            | 16/04/2020     |
| MN                      | 02/03/2020   | 2,75        | 4.823.851,26          | 45            | 16/04/2020     |
| MN                      | 05/03/2020   | 2,75        | 27.874.171,60         | 35            | 09/04/2020     |
| MN                      | 05/03/2020   | 2,75        | 9.262.854,40          | 43            | 17/04/2020     |
| MN                      | 09/03/2020   | 2,75        | 17.170.400,00         | 45            | 23/04/2020     |
| MN                      | 11/03/2020   | 2,75        | 22.008.173,16         | 44            | 24/04/2020     |
| MN                      | 13/03/2020   | 2,75        | 28.539.600,00         | 45            | 27/04/2020     |
| MN                      | 13/03/2020   | 2,75        | 2.529.288,45          | 45            | 27/04/2020     |
| MN                      | 16/03/2020   | 2,75        | 4.524.144,08          | 43            | 28/04/2020     |
| MN                      | 16/03/2020   | 2,75        | 13.183.500,00         | 45            | 30/04/2020     |
| MN                      | 19/03/2020   | 2,75        | 12.843.700,00         | 42            | 30/04/2020     |
| MN                      | 20/03/2020   | 2,75        | 4.513.977,03          | 40            | 29/04/2020     |
| MN                      | 23/03/2020   | 2,75        | 14.907.630,40         | 45            | 07/05/2020     |
| MN                      | 24/03/2020   | 2,75        | 16.218.695,79         | 45            | 08/05/2020     |
| MN                      | 26/03/2020   | 2,77        | 119.576.883,15        | 43            | 08/05/2020     |
| MN                      | 26/03/2020   | 2,75        | 30.423.116,85         | 43            | 08/05/2020     |
| MN                      | 27/03/2020   | 3,90        | 71.500.754,80         | 45            | 11/05/2020     |
| MN                      | 27/03/2020   | 2,75        | 1.727.282,65          | 45            | 11/05/2020     |
| <b>Total Vigente Bs</b> |              |             | <b>453.389.025,97</b> |               |                |

**ii. Oferta diaria de Reportos**

(\*) Vigente del 19/03/2020 al 01/04/2020

Para Valores Públicos y Valores de Emisores Privados (DPF)

| Moneda | Monto Diario Disponible desde 7-11-19 | Tasa        | TEA (e) | Tasa     | TEA (e) | Plazo (En días) | Tasa de        |
|--------|---------------------------------------|-------------|---------|----------|---------|-----------------|----------------|
|        |                                       | Subasta (d) | Subasta | Mesa (f) | Mesa    | Máximo          | Valoración (g) |
| MN     | 150.000.000                           | 2,75%       | 2,78%   | 3,25%    | 3,30%   | 45              | 7,75%          |
| ME     | 5.000.000                             | 4,00%       | 4,08%   | 4,50%    | 4,60%   | 15              | 12,50%         |

d) Tasa vigente del 19/03/2020 al 01/04/2020.

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.

g) Tasa utilizada para determinar el Valor de Ida en una operación de reporte. Para MN con valores de emisores privados: DPF AAA (9,25%) y DPF AA1 (9,75%). Para MN-UFV la tasa es 5,75%

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

| Tramos | MN    | TEA (i) | ME    | TEA (i) |
|--------|-------|---------|-------|---------|
| 1er    | 3,25% | 3,30%   | 5,50% | 5,65%   |
| 2do    | 3,75% | 3,82%   | 6,00% | 6,18%   |

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 14/2020  
miércoles 01/04/2020 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 | 50.000   |
| 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 |
| 23-mar             | -     | -     | -          | -           | -       | -                     | -     | -          | -           | -     |
| 24-mar             | 8,60% | 8,60% | 8,60%      | 7           | 60.000  | 2,80%                 | 2,80% | 2,80%      | 3           | 4.000 |
| 25-mar             | 8,60% | 8,60% | 8,60%      | 7           | 155.000 | -                     | -     | -          | -           | -     |
| 26-mar             | 8,60% | 8,60% | 8,60%      | 7           | 35.000  | -                     | -     | -          | -           | -     |
| 27-mar             | 8,60% | 8,65% | 8,63%      | 7           | 115.000 | -                     | -     | -          | -           | -     |

Operaciones interbancarias realizadas por sondeo. Datos Preliminares.

(\*) Incluye operaciones de Entidades Financieras de Vivienda.

(\*\*) Promedio Ponderado por monto y plazo.

III. OPERACIONES DE REPORTE REALIZADAS EN LA BOLSA BOLIVIANA DE VALORES 27/03/2020

| 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          | 553.891,31                                 | BS     | BGA     |   |        |         |         | 3,30%   |         |
| Bonos del Banco Central de Bolivia  |  |        | BME     |   |        |         |         |         | 3,79%   |
| Bonos de Largo Plazo                | 43.367,35                                  |        | BNB     |   |        |         |         |         | 3,00%   |
| Bonos Municipales                   | 3.689,87                                   |        | BSO     | 3,90%   |        |         |         |         | 3,00%   |
| Bonos del Tesoro                    | 2.715.474,50                               |        | BTB     |   |        |         |         |         | 2,70%   |
| Cupones de Bonos                    | 730.758,02                                 |        | FEF     |   | 3,50%  |         |         | 3,50%   | 3,78%   |
| Depósitos a Plazo Fijo              | 15.061.201,27                              |        | FFO     |   | 3,50%  |         |         |         | 4,50%   |
| Letras del Banco Central de Bolivia |  |        | FIE     |   |        |         |         |         | 3,49%   |
| Letras BCB Prepagables              |  |        | BEC     |   |        |         |         |         | 4,00%   |
| Pagarés Bursátiles                  |  |        | BSO     |   |        |         |         |         | 4,00%   |
| Valores de Contenido Crediticio     | 402.215,89                                 |        | BLP     |   |        |         |         |         | 4,30%   |
| <b>Total</b>                        | <b>19.510.598,21</b>                       |        | BMS     |   |        |         |         |         | 4,00%   |
|                                     |  |        | BTS     |   |        | 5,50%   |         | 5,50%   |         |
|                                     |  |        | CUP     |   |        |         |         |         | 2,50%   |
|                                     |  |        | VTD     |   |        |         |         |         | 4,30%   |
|                                     |  | PMT    |         |   |        |         |         | 4,30%   |         |
|                                     |  | USD    | BBB     | BNB   |        |         |         |         | 0,50%   |

Fuente: BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 27/03/2020

| Moneda               | Mercado Bursátil |         |         |             |
|----------------------|------------------|---------|---------|-------------|
|                      | CVT              | Reporto | General | Min Max     |
| Plazos Hasta 45 Días |                  |         |         |             |
| MN                   | 3,60%            | 3,52%   | 3,53%   | 2,70% 4,50% |
| MU                   |                  |         |         |             |
| ME                   |                  |         |         |             |
| MY                   |                  |         |         |             |
| MV                   |                  |         |         |             |

Fuente: BBV

V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

| A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO |             |             |             |             |              |
|-------------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
| Plazo semanas                 | EEUU        | Arg \$      | Chile \$    | Méx MN(k)   | Libor (\$us) |
|                               | 27-mar-2020 | 12-mar-2020 | 12-mar-2020 | 27-mar-2020 | 27-mar-2020  |
| 4                             | -0,05 ↑     | -           | 1,75        | 6,51 ↓      | 0,989 ↑      |
| 13                            | -0,01 ↑     | -           | -           | 6,54        | 1,450 ↑      |
| 26                            | 0,04 ↑      | -           | -           | 6,44 ↑      | 1,072 ↑      |
| 52                            | -           | -           | -           | 6,36 ↓      | 0,969 ↓      |
| Prime Rate                    | 3,25        |             |             |             |              |
| Fed Funds                     | 0,10        |             |             |             |              |

(k) Mercado Secundario.

| B. TIPOS DE CAMBIO                |           |               |           |
|-----------------------------------|-----------|---------------|-----------|
| TIPO DE CAMBIO (l) al 27-mar-2020 |           |               |           |
| Argentina                         | 64,329 ↑  | Japón         | 108,040 ↓ |
| Reino Unido                       | 0,808 ↓   | México        | 23,426 ↑  |
| Brasil                            | 5,124 ↑   | Perú          | 3,422 ↓   |
| Chile                             | 835,990 ↑ | Unión Europea | 0,9034 ↓  |

(l) Respecto al dólar

Atentamente,

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