



Información del 27-11-2020 al 30-11-2020

**OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO**

TIPO DE CAMBIO			UFV
Fecha	Compra	Venta	
30/11/2020	6,86	6,96	2,35978

**I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO**

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

**i. Vigente del 27/11/2020 al 01/12/2020**

No existe oferta regular

**B. OPERACIONES DE REPORTE**

**i. Operaciones de Reporto vigentes**

Moneda	F. Operación	T. Premio %	Monto	Plazo en días	F. Vencimiento
MN	08/10/2020	2,00	12.558.000,00	60	07/12/2020
MN	12/10/2020	2,00	6.404.670,63	60	11/12/2020
MN	15/10/2020	2,00	10.084.146,99	55	09/12/2020
MN	15/10/2020	2,00	1.921.558,45	56	10/12/2020
MN	20/10/2020	2,00	1.086.820,08	58	17/12/2020
MN	20/10/2020	2,00	20.195.096,84	50	09/12/2020
MN	21/10/2020	2,00	48.591.100,00	58	18/12/2020
MN	22/10/2020	2,00	64.339.280,00	60	21/12/2020
MN	03/11/2020	2,00	9.635.466,00	45	18/12/2020
MN	03/11/2020	2,00	5.320.734,18	45	18/12/2020
MN	05/11/2020	2,00	4.039.169,20	60	04/01/2021
MN	09/11/2020	2,00	17.759.278,44	59	07/01/2021
MN	09/11/2020	2,00	1.288.807,40	45	24/12/2020
MN	09/11/2020	2,00	1.933.211,10	45	24/12/2020
MN	09/11/2020	2,00	1.288.807,39	45	24/12/2020
MN	09/11/2020	2,00	100.998.311,98	60	08/01/2021
MN	10/11/2020	2,00	3.817.953,80	59	08/01/2021
MN	10/11/2020	2,00	12.436.200,00	59	08/01/2021
MN	11/11/2020	2,00	5.006.416,78	57	07/01/2021
MN	16/11/2020	2,00	9.963.891,02	60	15/01/2021
MN	16/11/2020	2,00	3.508.614,65	60	15/01/2021
MN	16/11/2020	2,00	11.090.340,51	60	15/01/2021
MN	18/11/2020	2,00	9.970.112,77	56	13/01/2021
MN	19/11/2020	2,00	63.717.739,70	35	24/12/2020
MN	24/11/2020	2,50	20.274.592,30	59	22/01/2021
MN	24/11/2020	2,50	75.046.429,24	59	22/01/2021
MN	25/11/2020	2,50	77.211.329,55	58	22/01/2021
MN	25/11/2020	2,50	51.837.736,91	58	22/01/2021
MN	25/11/2020	2,50	56.508.087,21	58	22/01/2021
MN	25/11/2020	2,50	19.541.738,60	58	22/01/2021
MN	26/11/2020	2,00	4.228.328,38	60	25/01/2021
MN	26/11/2020	2,00	73.852.506,86	60	25/01/2021
MN	26/11/2020	2,00	18.525.539,12	55	20/01/2021
			<b>*)Total Vigente</b>	823.982.016,08	

\*)En fecha 27-11-2020, cancelación anticipada de postura Nro.:2861 por Bs 17.759.278,44 operación de fecha 9/11/2020

**ii. Reportos Excepcionales vigentes**

Moneda		F. Operación	T. Premio % Promedio	Monto *)	Plazo en días	F. Vencimiento
MN	Ent. Bancarias	02/10/2020	0,20	622.474.355,58	90	31/12/2020
MN	Ent. No Bancarias	02/10/2020	0,20	91.622.547,79	90	31/12/2020
MN	Ent. Bancarias	09/10/2020	0,20	478.064.462,34	90	07/01/2021
MN	Ent. No Bancarias	09/10/2020	0,20	23.324.655,44	90	07/01/2021
MN	Ent. Bancarias	16/10/2020	0,50	100.000.000,00	90	14/01/2021
MN	Ent. No Bancarias	16/10/2020	0,50	99.237.815,66	90	14/01/2021
MN	Ent. Bancarias	23/10/2020	0,20	150.000.000,00	90	21/01/2021
MN	Ent. No Bancarias	23/10/2020	0,48	29.399.673,88	90	21/01/2021
MN	Ent. Bancarias	30/10/2020	0,50	29.999.999,99	90	28/01/2021
MN	Ent. No Bancarias	30/10/2020	0,50	4.281.573,12	90	28/01/2021
			<b>Total Vigente</b>	1.628.405.083,80		

\*)En fecha 15-10-2020, cancelación anticipada por Bs15.544.849,67 de f. 2/10/2020

**iii. Oferta diaria de Reportos**

(\*) Vigente del 26/11/2020 al 02/12/2020

Para Valores Públicos y Valores de Emisores Privados (DPF)

Moneda	Monto Diario		Tasa		TEA (e)	Tasa Mesa (f)	TEA (e) Mesa	Plazo (En días) Máximo	Tasa de Valoración (g)
	Disponible	desde 12-06-20	Subasta (d)	Subasta					
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 26/11/2020 al 02/12/2020.

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

iv. 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%

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 49/2020  
miércoles 02/12/2020 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

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
23-nov	9,50%	9,50%	9,50%	10	45.000	-	-	-	-	-
24-nov	9,50%	9,50%	9,50%	13	20.000	4,50%	4,50%	4,50%	6	3.000
25-nov	9,50%	9,50%	9,50%	15	30.000	4,50%	4,50%	4,50%	7	5.000
26-nov	-	-	-	-	-	4,50%	4,50%	4,50%	7	7.000
27-nov	9,75%	9,75%	9,75%	10	20.000	-	-	-	-	-

Operaciones interbancarias realizadas por sondes. 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 27/11/2020

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	1.323.307,82	BS	BEC			8,50%			
Bonos del Banco Central de Bolivia			BIS			9,00%			
Bonos de Largo Plazo	943.546,89		BME	9,52%		7,00%		5,00%	7,00%
Bonos Municipales			BNB	8,50%					
Bonos del Tesoro	1.010.484,92		BSO	6,31%	10,69%				
Cupones de Bonos			BTB	7,00%		8,00%			
Letras del Tesoro			BUN	5,77%					
Depósitos a Plazo Fijo	34.109.202,17		FCO	24,72%					
Letras del Banco Central de Bolivia			FEF	18,00%					8,00%
Letras BCB Prepagables			FFO		9,00%				8,60%
Pagarés Bursátiles			FIE	3,50%	11,00%	9,27%		6,82%	6,50%
Valores de Contenido Crediticio	25.063,40		FPR						11,55%
<b>Total</b>	<b>37.411.605,20</b>		NFB		8,81%	6,50%			
			FEF						5,00%
		FIE						5,00%	
		BLP						4,50%	
		IOL						4,50%	
		NIB							
		TGN					5,50%		
		BTS					10,00%	10,00%	
		CRP						7,68%	
		FUB						5,50%	
		BBB						0,60%	
		BLP						0,60%	
		TYS						0,60%	

Fuente: BBV

IV. TASAS PROMEDIO PONDERADAS AL 27/11/2020

Moneda	Mercado Bursátil			
	CVT	Reporto	General	Min Max
Plazos Hasta 45 Días				
MN	4,48%	9,26%	9,18%	3,50% 30,00%
MU				
ME				
MY				
MV				

Fuente: BBV

V. MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO					
Plazo semanas	EEUU	Arg \$	Chile \$	Méx MN <sub>(k)</sub>	Libor (\$us)
	27-nov-2020	25-nov-2020	25-nov-2020	27-nov-2020	27-nov-2020
4	0,08 ↑	-	-	4,33 ↑	0,155 ↑
13	0,08	-	-	4,33 ↑	0,225 ↑
26	0,09 ↑	-	-	4,34	0,257 ↑
52	-	-	-	4,38 ↑	0,330 ↓
Prime Rate		3,25			
Fed Funds		0,08			

(k) Mercado Secundario.

B. TIPOS DE CAMBIO			
TIPO DE CAMBIO (l) al		27-nov-2020	
Argentina	81,063 ↑	Japón	104,040 ↓
Reino Unido	0,752 ↑	México	20,077 ↑
Brasil	5,330 ↑	Perú	3,603
Chile	767,370 ↑	Unión Europea	0,8364 ↓

(l) Respecto al dólar

Atentamente,

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