

## NOTAS INFORMATIVO DIARIO DE OPERACIONES FINANCIERAS NACIONALES

### LIQUIDEZ DISPONIBLE EN EL BCCh CTA CTE

#### LIQUIDEZ EN CTA CTE (T-1)

**LIQUIDEZ:** Es el saldo inicial diario del sistema bancario en cuentas corrientes del BCCh. Se compone de FPD – FPL + DL a 1 día - REPO a 1 día + Encaje Mantenido constituido en Cuenta Corriente + Reserva Técnica constituida en Depósitos en \$. La información presentada corresponde a la del día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

### FACILIDADES PERMANENTES

#### FACILIDADES PERMANENTES (T-1)

**FPL (TPM + 25 pb):** Facilidad Permanente de Liquidez. Monto total de facilidad permanente de liquidez otorgado por el BCCh al sistema bancario a un día hábil plazo garantizado. La información presentada corresponde a la del día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

**FPD (TPM – 25 pb):** Facilidad Permanente de Depósito. Monto total de facilidad permanente de depósito efectuado por el sistema bancario en el BCCh, a un día hábil plazo. La información presentada corresponde a la del día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

### REQUERIMIENTOS DE RESERVA

#### ENCAJE (T-3)

**ENCAJE EXIGIDO:** Monto promedio diario exigido para el sistema. El encaje exigido se calcula sobre las obligaciones a la vista y las obligaciones a plazo netas. A comienzos de cada período de encaje se utiliza un dato provisorio, estimado por el sistema bancario, hasta la publicación del dato oficial por parte de la SBIF. La información presentada corresponde a la de 3 días hábiles previos a la fecha seleccionada (T-3).

**ENCAJE MANTENIDO (CAJA):** Monto diario de encaje mantenido por el sistema bancario en billetes y monedas en las bóvedas de los bancos, La información presentada por los bancos corresponde a la de 3 días hábiles previos a la fecha seleccionada (T-3).

**ENCAJE MANTENIDO (CTA CTE):** Monto diario de encaje mantenido por el sistema bancario como depósitos en cuenta corriente en el BCCh. La información presentada por los bancos corresponde a la de 3 días hábiles previos a la fecha seleccionada (T-3).

**SITUACIÓN DE ENCAJE (LIQUIDEZ):** Monto diario acumulado del diferencial entre el encaje mantenido por el sistema bancario y el encaje exigido durante el período. La información presentada por los bancos corresponde a la de 3 días hábiles previos a la fecha seleccionada (T-3).

#### **RESERVA TÉCNICA (T-1)**

**DEPÓSITO RT:** Corresponde a la obligación legal de mantener un encaje de 100% sobre los depósitos vista que excedan 2,5 veces el patrimonio efectivo del banco. Se permite constituirlo mediante títulos de deuda del BCCh, depósitos en pesos aplicados a reserva técnica y depósitos overnight en US\$ en el BCCh. La serie muestra la reserva técnica constituida como depósitos en pesos. La información presentada por los bancos corresponde a la del día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

#### **OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO**

**DL:** Depósito de Liquidez. Operación de ajuste, de contracción de liquidez en pesos, de uso discrecional del BCCh. La tasa de interés que se aplica a estas operaciones es la TPM. La información presentada corresponde a la del día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

**REPO:** Compra con pacto de retroventa. Operación de ajuste, de inyección de liquidez en pesos. Su aplicación puede ser discrecional o programada. Estas operaciones se realizan a TPM+spread. El spread puede ser mayor o igual a cero. La información presentada corresponde a la del día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

**LCGP:** Línea de Crédito con Garantía Prendaria. Operación de inyección de liquidez en pesos, mediante la prenda de colaterales a favor del BCCh durante el período de vigencia de la operación (no existe traspaso efectivo de posiciones). Estas operaciones se realizan a TPM+spread. El spread puede ser mayor o igual a cero. La información presentada corresponde a la del día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

**VENTA DE SWAP:** Operación de inyección de liquidez en pesos y contracción de liquidez en dólares, de uso programado y anunciado por el BCCh. La información presentada corresponde a la del día hábil previo a la fecha (T-1).

**COMPRA DE SWAP:** Operación de inyección de liquidez en dólares y contracción de liquidez en pesos, de uso programado y anunciado por el BCCh. La información presentada corresponde a la del día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

## **OPERACIONES CAMBIARIAS BCCh**

**COMPRA Y VENTA DE DIVISAS (T-1):** Resultado de operaciones de compra y/o venta de dólares efectuadas por el BCCh. La información presentada corresponde a la del día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

## **STOCK DE PAPELES VIGENTES BCCh**

**TOTALES BCCh SISTEMA BANCARIO (T-3):** Stock diario vigente de papeles del BCCh en posición del sistema bancario. La información presentada corresponde a la de 3 días hábiles previos a la fecha seleccionada (T-3).

**RESCATES BCCh (T):** Vencimiento de papeles del BCCh para el día, por instrumento. La información corresponde a la del día de la fecha seleccionada (T).

**STOCK TOTAL EN CIRCULACIÓN BCCh (T-1):** Stock diario de papeles del BCCh vigentes en el mercado nacional. La información presentada corresponde a la del día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

## **DEUDA EMITIDA EN PESOS BCCh**

**PDBC (T):** Resultado de licitaciones de pagarés descontables a tasa anual equivalente base 360 días. La información corresponde a la del día de la fecha seleccionada (T).

**BCP (T):** Resultado de licitaciones de bonos en pesos a tasa base 365 días. La información corresponde a la del día de la fecha seleccionada (T).

## **DEUDA EMITIDA EN UF BCCh (T)**

**BCU (T):** resultado de licitaciones de bonos en UF a tasa base 365días. La información corresponde a la del día de la fecha seleccionada (T).

## **STOCK DE PAPELES VIGENTES TESGRAL**

**TOTALES TESGRAL SISTEMA BANCARIO (T-3):** Stock diario de papeles vigentes, emitidos por la TESGRAL, en posición del sistema bancario. La información presentada corresponde a la de 3 días hábiles previos a la fecha seleccionada (T-3).

**RESCATES TESGRAL (T):** Vencimiento de papeles de la TESGRAL para el día, por instrumento. La información corresponde a la del día de la fecha seleccionada (T).

**STOCK TOTAL EN CIRCULACIÓN TESGRAL (T-1):** Stock diario de papeles de la TESGRAL vigentes en el mercado nacional. La información presentada corresponde a la del día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

## **DEUDA EMITIDA EN PESOS TESGRAL**

**BTP (T):** Resultado de licitaciones de bonos en pesos, emitidos por la TESGRAL a tasa base 365 días. La información corresponde a la del día de la fecha seleccionada (T).

## **DEUDA EMITIDA EN UF TESGRAL**

**BTU (T):** Resultado de licitaciones de bonos en UF, emitidos por la TESGRAL a tasa base 365 días. La información corresponde a la del día de la fecha seleccionada (T).

## **MERCADO CAMBIARIO FORMAL**

**MERCADO SPOT (T-2):** Corresponde al flujo diario de compras y ventas de moneda extranjera en el mercado spot, realizadas por las entidades que forman parte del mercado cambiario formal. Las compras y ventas a terceros excluyen arbitrajes de monedas extranjeras y operaciones interbancarias. Las suscripciones interbancarias corresponden solo a las compras de moneda extranjera entre dos entidades del mercado cambiario formal. La información presentada corresponde a la de 2 días hábiles previo a la fecha seleccionada (T-2).

**MERCADO DERIVADO LOCAL (T-2):** Corresponde al flujo diario de compras y ventas de moneda extranjera en el mercado a futuro, realizadas por las entidades que forman parte del mercado cambiario formal con contraparte del mercado local. Las compras y ventas a terceros excluyen arbitrajes de monedas extranjeras y operaciones interbancarias. Las suscripciones interbancarias corresponden solo a las compras de moneda extranjera a futuro entre dos entidades del mercado cambiario formal. Para las operaciones de derivados en moneda nacional (pesos o UF) contra moneda extranjera distinta del dólar estadounidense, se aplica la paridad correspondiente al último día hábil del mes anterior. La información presentada corresponde a la de 2 días hábiles previo a la fecha seleccionada (T-2).

**MERCADO DERIVADO EXTERNO (T-2):** Corresponde al flujo diario de compras y ventas de moneda extranjera en el mercado a futuro, realizadas por las entidades que forman parte del mercado cambiario formal con contraparte externa. Las compras y ventas a terceros excluyen arbitrajes de monedas extranjeras. La información presentada corresponde a la de 2 días hábiles previo a la fecha seleccionada (T-2).

## PRECIOS DE REFERENCIA

### MERCADO INTERBANCARIO

**TPM:** Tasa de política monetaria (base 360 simple) vigente el día de la fecha seleccionada (T-1).

**TIB:** Tasa interbancaria promedio diaria (base 360 simple) para las operaciones interbancarias a 1 día plazo no garantizadas entre los bancos. La información corresponde al día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

**TIB MAX:** Tasa interbancaria máxima observada en las operaciones interbancarias a 1 día plazo no garantizadas entre los bancos. La información corresponde al día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

**TIB MIN:** Tasa interbancaria mínima observada en las operaciones interbancarias a 1 día plazo no garantizadas entre los bancos. La información corresponde al día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

**MONTO:** Monto promedio diario de las operaciones interbancarias a 1 día plazo no garantizadas entre los bancos. La información corresponde al día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

**TASAS BOLSA:** Tasas promedio de los depósitos a plazo de los bancos (base 360 simple), observados en los remates de la Bolsa de Comercio de Santiago. A plazos de 30, 90, 180 y 360 días en pesos y a 360 días en UF. La información corresponde a dos días hábiles previo a la fecha seleccionada (T-2).

**TASAS SWAP PC:** Tasas promedio de los swap promedio de cámara transados (base 360 simple), para los plazos de 90, 180 y 360 días en pesos. La información corresponde al día hábil previo a la fecha seleccionada (T-1).

**TASAS BONOS \$:** Tasa promedio ponderada proveniente de las transacciones efectuadas diariamente de los instrumentos de referencia en pesos, emitidos por el Banco Central de Chile y/o la Tesorería General de la República de Chile. La información corresponde a dos días hábiles previo a la fecha seleccionada (T-2).

**TASAS BONOS UF:** Tasa promedio ponderada proveniente de las transacciones efectuadas diariamente de los instrumentos de referencia en UF, emitidos por el Banco Central de Chile y/o la Tesorería General de la República de Chile. La información corresponde a dos días hábiles previo a la fecha seleccionada (T-2).