

BANCO CENTRAL DE CHILE
DIVISION MERCADOS FINANCIEROS
DEPARTAMENTO OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO

martes, 11 de febrero de 2020

Anuncio de Bases de Licitación de Compra Swap de Divisas, Capítulo 2.4 del Compendio de Normas Monetarias y Financieras

Monto a licitar (millones de dólares)	200
Tipo de cambio spot	\$ 795,88
LIBOR al plazo	1,657292%
Premio sobre LIBOR mínimo a postular	2,00%
Tasa de postura	Act/360 (dos decimales)
Plazo del swap	35 días
Tasa pesos	TPM
Tipo de operación	Licitación
Modalidad de adjudicación	Holandesa
Modalidad de postulación	Tradicional
Número de posturas por institución	Sin límite
Postura mínima	USD 1.000 M
Múltiplo	USD 1.000 M
Fecha de inicio del Swap	martes, 11 de feb. de 20
Fecha de vencimiento del Swap	martes, 17 de mar. de 20
Moneda	Dólar de EE.UU.
Valuta	T+0
Flujo Inicial	Abono USD Cargo CLP
Flujo Final	Abono CLP Cargo USD
Moneda liquidación	CLP y USD
Plataforma de licitación	SOMA
Inicio de licitación	11:00 hrs.
Término de licitación	11:25 hrs.
Horario de cargo en cuenta pesos (T+0)	A partir de 12:00 hrs.
Horario de cargo en cuenta dólares al día de vencimiento	10:00-12:00 hrs.
<u>Capítulo 2.4 SWAP de Divisas</u>	
<u>Manual SOMA</u>	