



## **REGLAMENTO OPERATIVO DEL SISTEMA INTEGRADO DE INFORMACIÓN SOBRE TRANSACCIONES DE DERIVADOS**

El presente Reglamento Operativo (“RO-SIID” o “RO”) dispone las instrucciones aplicables a las operaciones de derivados que se deben reportar al Sistema Integrado de Información sobre transacciones de Derivados (“SIID”), administrado por el Banco Central de Chile (“BCCh” o el “Banco”), todo ello de conformidad a lo dispuesto en el Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras (“CNF”).

Los términos técnicos o financieros cuya inicial se exprese en mayúscula, que no se encuentren definidos en el presente RO, tendrán el significado que a dichos términos se haya asignado en el Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras.

- i. Las entidades obligadas a reportar al SIID (denominadas en conjunto “Participantes” o “Participantes del SIID”), corresponden a las señaladas en el numeral 1 de la Letra B) del Título I del citado Capítulo III.D.3. Esto es, Empresas Bancarias y filiales obligadas a reportar al SIID, Entidades MCF no bancarias, Otras Entidades Fiscalizadas CMF y Otros domiciliados o residentes en Chile.

La información requerida para fines de cumplir con las exigencias de información previstas en el referido Capítulo III.D.3 y el presente RO deberá ser debidamente reportada por los Participantes, en forma directa o a través de sus Agentes Autorizados, a la Gerencia de División Estadísticas del BCCh.

Entidades obligadas y periodicidad general de los reportes:

- Empresas bancarias y sus filiales a que se refiere el artículo 70 letra a) de la Ley General de Bancos (LGB), en adelante referidas conjuntamente como “Empresas Bancarias”:

Las Empresas Bancarias deberán reportar diariamente y sus filiales mensualmente, al Banco las operaciones de derivados que pacten sobre monedas (incluida la Unidad de Fomento), tasa de interés y renta fija con personas domiciliadas o residentes en Chile o en el exterior, sea que dicha información revista o no el carácter de información cambiaria.

La citada información de las Empresas Bancarias deberá ser confirmada o actualizada mensualmente para cada uno de los contratos de derivados (“Contrato” o “Contratos”) vigentes al cierre de cada mes y complementada con su valor de mercado, junto al detalle de las garantías involucradas en las operaciones en caso de haberlas. Asimismo, deberán reportar los pagos efectuados durante el mes inmediatamente anterior.

Asimismo, la CMF podrá solicitar información adicional o a nivel de cartera de instrumentos financieros derivados respecto de sus entidades fiscalizadas o filiales a que se refiere el artículo 70 letra a) de la LGB, quedando sujeta ésta a la revisión y validación que corresponda, por parte de dicha Comisión.

- Entidades MCF no bancarias y Otras Entidades Fiscalizadas por la CMF:

Las Entidades MCF no bancarias y las Entidades Fiscalizadas por la CMF, indicadas en el Capítulo III.D.3, deberán reportar mensualmente al Banco las operaciones de derivados sobre monedas, tasas de interés y renta fija que pacten con personas domiciliadas o residentes en el exterior, así como las operaciones de derivados sobre monedas extranjeras (FX) contratadas en el mercado local, en el carácter de información cambiaria.



- Otros Domiciliados o Residentes en Chile:

Las personas naturales o jurídicas distintas de las indicadas anteriormente deberán reportar mensualmente al Banco las operaciones de derivados sobre monedas, tasas de interés o renta fija que pacten con personas domiciliadas o residentes en el exterior, en el carácter de información cambiaria.

| Participantes del SIID   | Contraparte  | Monedas |       | Tasa de interés | Renta fija |
|--|--|---------|-------|-----------------|------------|
|  |  | FX      | \$/UF |                 |            |
| Empresas bancarias y sus filiales                                    | Empresas bancarias y sus filiales                                    | ✓✓      | ✓✓    | ✓✓              | ✓✓         |
|  | Entidades MCF no bancarias y Otras entidades fiscalizadas por la CMF | ✓✓      | ✓✓    | ✓✓              | ✓✓         |
|  | Otros domiciliados o residentes en Chile                             | ✓✓      | ✓✓    | ✓✓              | ✓✓         |
|  | Personas naturales o jurídicas establecidas en el exterior           | ✓✓      | ✓✓    | ✓✓              | ✓✓         |
| Entidades MCF no bancarias y Otras entidades fiscalizadas por la CMF | Empresas bancarias y sus filiales                                    | ✓✓      | -     | -               | -          |
|  | Entidades MCF no bancarias y Otras entidades fiscalizadas por la CMF | ✓✓      | -     | -               | -          |
|  | Otros domiciliados o residentes en Chile                             | ✓✓      | -     | -               | -          |
|  | Personas naturales o jurídicas establecidas en el exterior           | ✓✓      | ✓✓    | ✓✓              | ✓✓         |
| Otros domiciliados o residentes en Chile                             | Otros domiciliados o residentes en Chile                             | -       | -     | -               | -          |
|  | Personas naturales o jurídicas establecidas en el exterior           | ✓✓      | ✓✓    | ✓✓              | ✓✓         |

Las obligaciones de reporte señaladas en este RO-SIID deberán ser cumplidas a través del Portal Web del SIID (Portal SIID), para lo cual el respectivo Participante o su Agente Autorizado definido en el Capítulo III.D.3 del CNF, según corresponda, deberá solicitar al Banco una clave de acceso.

El Participante será responsable exclusivo de la información que se envíe al Banco, debiendo responder por la veracidad de la misma, sea que ella fuere reportada por sus empleados, contratistas o Agentes Autorizados, a quienes le haya otorgado el acceso.

Las especificaciones de la información requerida por el SIID, de acuerdo a cada activo subyacente, se encuentran detalladas en los Sistemas N°1, 2 y 3. El Anexo N° 1 dispone el modelo de solicitud de acceso que deberán suscribir los Participantes para remitir la información requerida al SIID, de conformidad con lo establecido en el Capítulo III.D.3 mencionado y en el RO-SIID. Por su parte, las Tablas y Codificaciones serán definidas por la Gerencia de Información de Estadísticas del Banco, mediante Carta Circular y estarán disponibles en forma actualizada en el Portal Web. El Anexo N° 2 contiene un índice de las Tablas del SIID.



En cualquier caso, se deja constancia que los Otros Domiciliados o Residentes en Chile que ya cuentan con clave para reportar sus operaciones de acuerdo a lo establecido en el Capítulo IX del Compendio de Normas de Cambios Internacionales del BCCh (CNCI) y su Manual de Procedimientos y Formularios de Información, no requerirán suscribir la solicitud de acceso señalada en el Anexo N° 1.

Dependiendo del activo subyacente sobre el que se pacte el respectivo Contrato, los Participantes deberán enviar al BCCh, a través del referido Portal SIID, la información que se indica a continuación:

## 1. Monedas

### Nuevas Operaciones

Para las operaciones de derivados, cuyo activo subyacente corresponda a monedas (incluidas monedas extranjeras, el peso chileno y la “Unidad de Fomento” como unidad de reajuste autorizada respecto de obligaciones pagaderas en moneda corriente), se deberá enviar la información requerida en la Sección A del Sistema N°1 de este RO.

### Modificaciones de Contratos

Las modificaciones a los Contratos vigentes, se deberán reportar de acuerdo a lo establecido en las instrucciones de la Sección A del Sistema N°1 de este RO.

### Contratos Vigentes

Se deberá enviar mensualmente el detalle de las condiciones financieras de los Contratos vigentes al cierre de cada mes, considerando la información solicitada sobre su valorización, el detalle de las garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior, según lo indicado en la Sección B del Sistema N°1 de este RO.

### Contratos Vencidos

Se deberá reportar mensualmente el detalle de los Contratos vencidos, terminados o ejecutados durante el transcurso en el mes inmediatamente anterior, según lo indicado en la Sección B del Sistema N°1 de este RO, sin perjuicio del reporte referido a la terminación de un Contrato conforme a la letra A de ese mismo Sistema.

### Periodicidad y plazos para reportar

Las Empresas Bancarias deberán proporcionar diariamente la información solicitada, el día hábil bancario siguiente al de las Nuevas Operaciones o Modificaciones de un Contrato, hasta las 10:00 AM de ese día. Adicionalmente, deberán enviar dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, la información de Contratos Vigentes y Contratos Vencidos en el mes inmediatamente anterior.

Por su parte, las Entidades MCF no bancarias, las filiales bancarias, las Otras Entidades Fiscalizadas CMF y otros Domiciliados o Residentes en Chile deberán reportar mensualmente la información requerida en el Sistema N°1 de este RO, dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, respecto a Contratos Vigentes y Contratos Vencidos en el mes inmediatamente anterior.

## 2. Tasa de Interés

### Nuevas Operaciones

Para las operaciones de derivados, cuyo activo subyacente corresponda a tasas de interés, se deberá reportar la información requerida en la Sección A del Sistema N°2 de este RO.



#### Modificaciones de Contratos

Las modificaciones a los Contratos vigentes, se deberán reportar de acuerdo a lo establecido en las instrucciones de la Sección A del Sistema N°2 de este RO.

#### Contratos Vigentes

Se deberá reportar mensualmente el detalle de las condiciones financieras de los Contratos vigentes al cierre de cada mes, considerando la información solicitada sobre su valorización a precios de mercado, el detalle de las garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior, según lo indicado en la Sección B del Sistema N°2 de este RO.

#### Contratos Vencidos

Se deberá reportar mensualmente el detalle de los Contratos vencidos, terminados o ejecutados en el transcurso en el mes inmediatamente anterior, según lo indicado en la Sección B del Sistema N°2 de este RO, sin perjuicio del reporte referido a la terminación de un Contrato conforme a la letra A de ese mismo Sistema.

#### Periodicidad y plazos para reportar

Las Empresas Bancarias deberán proporcionar diariamente, la información solicitada el día hábil bancario siguiente al de las Nuevas Operaciones o Modificaciones de un Contrato, hasta las 10:00 AM de ese día. Adicionalmente, deberán reportar dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, la información de Contratos Vigentes y Contratos Vencidos en el mes inmediatamente anterior.

Por su parte, las Entidades MCF no bancarias, las filiales bancarias, las Otras Entidades fiscalizadas CMF y otros Domiciliados o Residentes en Chile deberán reportar mensualmente la información requerida en el Sistema N°2 de este RO, dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, respecto a Contratos Vigentes y Contratos Vencidos en el mes inmediatamente anterior.

### 3. Renta Fija

#### Nuevas Operaciones

Para las operaciones de derivados, cuyo activo subyacente corresponda a renta fija, se deberá reportar la información requerida en la Sección A del Sistema N°3 de este RO.

#### Modificaciones de Contratos

Las modificaciones a los Contratos vigentes, se deberán reportar de acuerdo a lo establecido en las instrucciones de la Sección A del Sistema N°3 de este RO.

#### Contratos Vigentes

Se deberá reportar mensualmente el detalle de las condiciones financieras de los Contratos vigentes al cierre de cada mes, considerando la información solicitada sobre su valorización a precio de mercado, el detalle de las garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior, según lo indicado en la Sección B del Sistema N°3 de este RO.

#### Contratos Vencidos

Se deberá reportar mensualmente el detalle de los Contratos vencidos, terminados o ejecutados en el transcurso en el mes inmediatamente anterior, según lo indicado en la Sección B del Sistema N°3 de este RO, sin perjuicio del reporte referido a la terminación de un Contrato conforme a la letra A de ese mismo Sistema.

#### Periodicidad y plazos para reportar

Las Empresas bancarias deberán proporcionar diariamente, la información solicitada el día hábil bancario siguiente al de las Nuevas Operaciones o Modificaciones de un Contrato, hasta las 10:00 AM de ese día. Adicionalmente, deberán reportar dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, la información de Contratos Vigentes y Contratos Vencidos en el mes inmediatamente anterior.



Por su parte, las Entidades MCF no bancarias, las filiales bancarias, las Otras Entidades Fiscalizadas CMF y Otros Domiciliados o Residentes en Chile deberán reportar mensualmente la información requerida en el Sistema N°3 de este RO, dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, respecto a Contratos Vigentes y Contratos Vencidos en el mes inmediatamente anterior.

Conforme a lo expresado, el Participante debe tener presente que la información que proporcione al Banco sobre contratos de derivados, en forma electrónica a través del SIID, será entregada bajo juramento, en cuanto a que los datos contenidos en los reportes que remita al BCCh corresponderán en forma fidedigna y exacta a las operaciones que el Participante informe en cada caso, debiendo precisar además si los antecedentes que conforman el respectivo reporte dicen o no relación con el cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI.

Al respecto, tratándose de información cambiaria, el Participante dejará constancia expresa que estos antecedentes los proporcionará al Banco para dar cumplimiento a las normas contempladas en los Capítulos citados del CNCI, establecidas por el BCCh conforme a lo dispuesto en el Párrafo Octavo del Título III de su LOC, las que el Participante declarará conocer, asumiendo la responsabilidad que se establece en la normativa legal antedicha.

### **Normas Transitorias**

De acuerdo a las Normas Transitorias del Capítulo III.D.3 del CNF que establece el SIID, tanto esa normativa como el presente Reglamento Operativo (Capítulo III.D.3.1) comenzarán a regir a contar del día 3 de noviembre de 2020, sin perjuicio de aplicarse en forma diferida ciertas disposiciones del RO-SIID, a contar del mes de mayo de 2021, en lo concerniente al envío de los antecedentes a que se refieren los numerales 2 a 4 de dichas Normas Transitorias.

Lo anterior, es sin perjuicio de considerar también lo dispuesto en los numerales 5 y 6 de esas Normas Transitorias, referidos respectivamente a la aplicación de un período de marcha blanca para el SIID; y a la aplicación temporal de la normativa cambiaria vigente con anterioridad a la publicación del Acuerdo de Consejo N° 2236-01-190711, que aprobó el Capítulo III.D.3 citado, en tanto el SIID no comience a operar en un régimen definitivo.



## SISTEMA N°1

### ESPECIFICACIONES DE LA INFORMACIÓN REQUERIDA RESPECTO DE “OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS SOBRE MONEDAS”

#### I. INSTRUCCIONES GENERALES:

La información requerida de conformidad con este Sistema deberá ser considerada por los Participantes, para reportar las operaciones con instrumentos derivados cuyo activo subyacente corresponda a monedas. Para ello se deberá enviar la información solicitada en este Sistema a la Gerencia de División Estadísticas del BCCh a través del Portal SIID ([www.siid.cl](http://www.siid.cl)) u otra dirección que el Banco pueda informar.

Las Empresas Bancarias deberán reportar hasta las 10:00 AM del día hábil bancario siguiente las Nuevas Operaciones y Modificaciones efectuadas a los Contratos. Adicionalmente, deberán informar dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, los antecedentes de los Contratos Vigentes y Contratos Vencidos en el mes inmediatamente anterior, de acuerdo a las instrucciones contenidas en las diferentes secciones de las Especificaciones contenidas en este Sistema.

Los Participantes que no correspondan a Empresas Bancarias, deberán reportar mensualmente dentro de los cinco primeros días hábiles bancarios de cada mes, la información de los Contratos Vigentes y Contratos Vencidos en el mes inmediatamente anterior.

#### SECCIÓN A: Información Diaria de Nuevas Operaciones, Modificaciones y Términos.

##### 1) Nuevas Operaciones

Para reportar las nuevas operaciones pactadas por los Participantes, estos deberán enviar al Banco los campos pertenecientes a la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, indicando en el campo “Evento de Reporte” alguno de los eventos detallados en el numeral “2.1 Suscripción”.

##### 2) Modificaciones de Contratos

Los Participantes que efectúen modificaciones a sus Contratos, deberán reportar todos los campos previamente reportados actualizados, indicando como “Evento de Reporte” alguno de los señalados en el numeral “2.2 Modificación”.

Los campos “RUT Participante (Contraparte 1)”, “LEI Contraparte 1”, “Identificador del Contrato”, “Identificador de Operaciones Estructuradas” y “Fecha y hora de suscripción del Contrato” son los que permitirán identificar la operación previamente informada sobre la cual se aplicará la modificación o el término anticipado. Debido a lo anterior, dichos campos no podrán ser modificados por los Participantes.

##### 3) Términos Anticipados y Anulaciones de Contratos

En el caso de los Participantes que transfieran a un tercero el Contrato previamente reportado, pongan término a este en una fecha anterior a lo inicialmente establecido, o anulen el envío del Contrato al SIID, deberán enviar al Banco la información que aplica a los eventos de reporte “2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación”, “2.3.2 Cesión” o “2.3.3 Anulación”, según corresponda.



## SECCIÓN B: Información Mensual de Contratos Vigentes y Contratos Terminados

### 1) Contratos Vigentes

Los Participantes deberán reportar, respecto de cada Contrato Vigente al término del mes calendario, la última información disponible para los campos de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, además de los pertenecientes a las Secciones 2 “Pagos”, 3 “Garantías” y 4 “Valor de Mercado”, indicando como “Evento de Reporte” la opción “2.4 Vigencia”.

La información de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación” será entendida como una confirmación sobre las condiciones vigentes del derivado al cierre del mes informado.

La información de la Sección 2 “Pagos” hará referencia a cualquier pago o intercambio de flujos originado por la operación en cuestión, efectuado durante el transcurso del mes informado.

La información de las Secciones 3 “Garantías” y 4 “Valor de Mercado” deberá ser reportada indicando las condiciones vigentes al cierre del mes informado.

### 2) Contratos Terminados

Los Participantes deberán reportar, para cada Contrato Terminado indicando como “Evento de Reporte” la opción “2.3.4 Vencimiento”, la información vigente al momento del término de éste, completando la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, además de la Sección 2 “Pagos”.

Se deberán incluir también mensualmente en este Evento de Reporte aquellos Contratos que fueron terminados por “2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación” o “2.3.2 Cesión”.

La información de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, será entendida como una confirmación sobre las condiciones vigentes del derivado al momento de su término.

La información reportada en la Sección 2 “Pagos” hará referencia a cualquier pago o intercambio de flujos originado por la operación en cuestión, efectuados durante el transcurso del mes informado.

En la información que se proporcione bajo juramento, referida a Contratos sobre monedas, se precisará si dichos antecedentes dicen relación con el cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI.



## II. INFORMACIÓN SOLICITADA

### Sección 1: Condiciones Financieras de la Operación

| N° Campo                      | Campo                        | Descripción original  |
|-------------------------------|------------------------------|---|
| <b>A. Información General</b> |                              |   |
| 1                             | Naturaleza de la Información | Debe precisarse si los antecedentes que conforman el respectivo Evento de Reporte, se entregan o no al BCCh en cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI, sobre operaciones con instrumentos derivados.   |
| 2                             | Evento de Reporte            | <p>Código que identifica el tipo de registro que será informado o reportado, según la Tabla Eventos de Reporte. Este podrá corresponder a:</p> <p><b>2.1 Suscripción</b></p> <p>2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante.</p> <p>2.1.2 Adquisición por cesión: Cuando el Participante asume las obligaciones y es cesionario de los derechos vinculados a un Contrato suscrito anteriormente por un tercero.</p> <p>Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la celebración de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar un evento de suscripción para cada instrumento comprendido en la estructura.</p> <p><b>2.2 Modificación</b></p> <p>Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante.</p> <p>2.2.1 <i>Recouping</i>: Modificación de las condiciones financieras de un Contrato a consecuencia de pagos que hacen las partes con el objeto de modificar su valor razonable (<i>mark to market</i>).</p> <p>2.2.2 Modificación de contraparte por cesión: El Participante que permanece en el Contrato cedido debe informar que su contraparte ha cambiado producto de una cesión. No procederá informar como cesión la novación de las obligaciones de un Contrato producto de la compensación y liquidación de las mismas en una entidad de Entidad de Contraparte Central.</p> <p>2.2.3 Otras modificaciones: Cuando se realicen otros cambios a alguna de las condiciones financieras del Contrato y que no correspondan a una corrección de reporte, tales como: fechas de vencimiento, montos pactados, precios pactados, precios referenciales de mercado a utilizar en caso de compensación, cambios en la modalidad de entrega y liquidación, y cambios en las partes compradora o vendedora por causales distintas de cesión.</p> |





| N° Campo | Campo  | Descripción original   |
|----------|--|--|
|          |  | <p>2.2.4 Corrección de reporte: Rectificación de información enviada previamente por el Participante que no corresponda a una modificación contractual.</p> <p><b>2.3 Término</b></p> <p>Corresponde al evento de terminación o pérdida de vigencia de una operación reportada previamente por el Participante, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.</p> <p>2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación: Caducidad o término de forma anticipada del Contrato por causales contempladas en el Contrato respectivo, por causa legal, acuerdo de las partes, incluyendo la compresión u optimización de cartera.</p> <p>2.3.2 Cesión: Transferencia a un tercero de un Contrato previamente reportado por el Participante (cedente).</p> <p>2.3.3 Anulación: Eliminación de la información referida a un Contrato informado previamente, debido a que este nunca existió (ej. duplicaciones, cotizaciones, error de información, entre otros) o bien no estaba afecto a la regulación de derivados de monedas del Capítulo III.D.3 del CNF y su respectivo Reglamento Operativo.</p> <p>2.3.4 Vencimiento: Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha de término del Contrato, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vencidos, junto con la información de pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior.</p> <p><b>2.4 Vigencia</b></p> <p>Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha del reporte, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vigentes, junto con la información sobre valorizaciones, garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior.</p> |
| 3        | RUT Participante (Contraparte 1)                 | RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).  |
| 4        | LEI Contraparte 1                                | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas, si lo tuviere.  |
| 5        | RUT Contraparte del Participante (Contraparte 2) | RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar.  |
| 6        | LEI Contraparte 2                                | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar, si lo tuviere.  |
| 7        | Nombre o Razón Social Contraparte 2              | Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.   |



| N° Campo | Campo   | Descripción original  |
|----------|---|---|
| 8        | País Contraparte 2  | Código del país de residencia o domicilio de la Contraparte 2, de acuerdo a la norma ISO 3166-1 alpha-3.  |
| 9        | RUT de Entidad de Contraparte Central   | RUT (Rol Único Tributario) de la Entidad de Contraparte Central establecida en Chile conforme a la Ley N° 20.345, a través de la cual se haya convenido realizar la liquidación de las obligaciones correspondientes al Contrato.   |
| 10       | LEI de Entidad de Contraparte Central   | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ), si lo tuviere, asignado a la Entidad de Contraparte Central a través de la cual se haya convenido realizar la liquidación de las obligaciones correspondientes al Contrato.  |
| 11       | RUT Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1 | En el caso de que un Contrato sea liquidado en una Entidad de Contraparte Central u otro agente liquidador, y que la Contraparte 1 no sea miembro de dicha entidad, se debe indicar el RUT (Rol Único Tributario) de quien opera como Participante Directo o bien como Agente Liquidador de la Contraparte 1 ante la Entidad de Contraparte Central.  |
| 12       | LEI Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1 | En el caso de que un Contrato sea liquidado en una Entidad de Contraparte Central u otro agente liquidador, y que la Contraparte 1 no sea miembro de dicha entidad, se debe indicar el Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ) asignado a la entidad que opera como Participante Directo o bien como Agente Liquidador de la Contraparte 1 ante la Entidad de Contraparte Central, si lo tuviere. |
| 13       | RUT Agente de Cálculo   | RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato.  |
| 14       | LEI Agente de Cálculo   | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ), si lo tuviere, asignado a la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato  |
| 15       | Nombre o Razón Social Agente de Cálculo   | Nombre o razón social de la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato.   |
| 16       | RUT del Cedente o Cesionario  | RUT (Rol Único Tributario) de la Contraparte domiciliada o residente en Chile que cede (evento suscripción 2.1.2 "Adquisición por Cesión", evento de modificación 2.2.2 "Modificación de Contraparte por Cesión") o a la que se cede (evento término 2.3.2 "Cesión") un Contrato.<br><br>Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.   |



| N° Campo | Campo   | Descripción original   |
|----------|---|--|
| 17       | LEI Cedente o Cesionario                          | <p>Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>), si lo tuviere, asignado a la Contraparte que cede (Evento Suscripción 2.1.2 “Adquisición por Cesión”, Evento de Modificación 2.2.2 “Modificación de Contraparte por Cesión”) o a la que se cede (Evento Término 2.3.2 “Cesión”) un Contrato.</p> <p>Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.</p>   |
| 18       | Identificador del Contrato                        | <p>Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (<i>Unique Transaction Identifier</i>), debe ser indicado en este campo.</p> <p>Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.</p> |
| 19       | Identificador del Contrato para Agente Autorizado | <p>Código único asignado por el Agente Autorizado a cada Contrato suscrito por el Participante.</p> <p>Este campo puede ser informado solo cuando el envío de información al SIID sea realizado por un Agente Autorizado a nombre del Participante.</p>  |
| 20       | Identificador de Operaciones Estructuradas        | <p>Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato).</p> <p>Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.</p>   |
| 21       | Instrumento                                       | <p>Tipo de instrumento al que corresponde la operación informada, según la Tabla de Instrumentos.</p>  |
| 22       | Opciones: Clase                                   | <p>Clase de opción a que corresponde la operación informada, de acuerdo a la modalidad de ejercicio pactada en el Contrato, según lo señalado en la Tabla Clase de Opción.</p>   |
| 23       | Opciones: Posición en la Operación                | <p>Indicar si la Contraparte 1 asume la posición compradora o vendedora en la opción, según lo señalado en la Tabla Tipo de Posición.</p>  |
| 24       | Opciones: Instrumento Subyacente                  | <p>Indicar si el ejercicio de la opción implica la entrada en vigencia de un nuevo derivado (ejemplo <i>swaption</i>). Si este es el caso, reportar el instrumento subyacente correspondiente, según lo señalado en la Tabla Opciones - Instrumento Subyacente.</p>  |



| N° Campo | Campo                                    | Descripción original  |
|----------|--|---|
| 25       | Modalidad de Liquidación                 | Modalidad estipulada en el Contrato para llevar a cabo los pagos o liquidaciones de principales que éste origine, la cual puede ser por compensación o entrega física, según lo señalado en la Tabla Modalidad de Liquidación.  |
| 26       | Moneda de Compensación                   | Código de la moneda en la cual se realiza la compensación, según norma ISO 4217, en caso de haberse pactado dicha modalidad de liquidación.   |
| 27       | Moneda Comprada                          | Código de la moneda subyacente a recibir por la Contraparte 1 en cada fecha de pago o al vencimiento de la operación, según norma ISO 4217.   |
| 28       | Monto Moneda Comprada                    | Monto de la moneda subyacente a recibir por la Contraparte 1 al término de la operación.  |
| 29       | Moneda Vendida                           | Código de la moneda subyacente a entregar por la Contraparte 1 en cada fecha de pago o al término de la operación, según norma ISO 4217   |
| 30       | Monto Moneda Vendida                     | Monto de la moneda subyacente a entregar por la Contraparte 1 en cada fecha de pago o al término de la operación.   |
| 31       | Tipo de Tasa de Interés a Recibir        | Indicar si la tasa de interés recibida por la Contraparte 1 es fija o una de tipo variable, según lo señalado en la Tabla Tipo de Tasa de Interés.  |
| 32       | Tipo de Tasa de Interés a Entregar       | Indicar si la tasa de interés entregada por la Contraparte 1 es fija o una de tipo variable, según lo señalado en la Tabla Tipo de Tasa de Interés.   |
| 33       | Fecha y hora de suscripción del Contrato | Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato.  |
| 34       | Fecha de Inicio                          | Fecha en la cual comienzan a devengarse los intereses de la operación en favor de alguna de las contrapartes. Este campo se debe completar cuando hay un único flujo. En el caso de haber más intercambios se debe indicar la fecha de inicio para cada uno de los flujos en la sección de calendario de pagos. |



| N° Campo | Campo                              | Descripción original  |
|----------|------------------------------------|---|
| 35       | Fecha de <i>Fixing</i> 1           | <p>Fecha que se considera para el tipo de cambio, precio o índice de referencia utilizado en el cálculo de la compensación del derivado, según se estipule en el Contrato.</p> <p>Para un instrumento "asiático" será la fecha inicial del período de fechas a considerar en el <i>fixing</i>. Para un instrumento "americano" o "bermuda", esta fecha será la primera en la cual podrá ser ejercido el derecho.</p>                                  |
| 36       | Fecha de <i>Fixing</i> 2           | <p>Fecha final del período a considerar en el <i>fixing</i> de una operación "asiática", o bien la última en la cual podrá ser ejercido el derecho de una operación "americana" o "bermuda".</p>  |
| 37       | Fecha de Término                   | <p>Fecha en la cual vence o madura la operación de acuerdo a lo establecido originalmente en el Contrato. En el caso de un anticipo se debe reportar la nueva fecha de término en el campo "Fecha Efectiva de Término o Liquidación Anticipada".</p>  |
| 38       | Fecha de Pago de la Operación      | <p>Fecha de la última liquidación de la operación.</p>  |
| 39       | Fecha de Inicio de la Modificación | <p>Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una Modificación.</p>   |
| 40       | Convención Tipo de Cambio          | <p>Convención de tipo de cambio definida en el Contrato para expresar la información de precios de la operación, utilizando los códigos ISO 4217 para las monedas involucradas separados por el signo "/" (por ejemplo, CLP/USD corresponde a pesos chilenos por un dólar de Estados Unidos de América).</p>  |
| 41       | Precio Pactado a Futuro            | <p>Tipo de cambio a futuro, el cual debe ser expresado conforme a la "Convención Tipo de Cambio" definida en el Contrato. Para el caso de una opción, este campo corresponde al <i>Precio Strike</i>.</p> <p>Para operaciones que se suscriban con precio futuro desconocido al momento de su cierre, este campo no deberá ser completado. Al momento de conocerse el precio de intercambio, este deberá ser informado mediante una modificación.</p> |
| 42       | Puntos Forward                     | <p>Diferencia entre el Precio Pactado a Futuro y el Precio Spot considerado en la negociación.</p>  |
| 43       | Moneda de Prima/Pago inicial       | <p>Si la operación corresponde a una Opción o involucra el pago de una prima o un monto compensatorio entre las partes al inicio del Contrato, se debe indicar la moneda de dicho pago.</p> <p>En el caso de una cesión, si el Participante (Contraparte 1) ha entregado o recibido un pago debe indicar la moneda de este.</p> <p>Se debe indicar el código de la moneda, según norma ISO 4217.</p>  |



| N° Campo | Campo   | Descripción original  |
|----------|---|---|
| 44       | Monto Prima/Pago Inicial Recibida(o)          | Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.   |
| 45       | Monto Prima/Pago Inicial Entregada(o)         | Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.  |
| 46       | Precio Barrera de Entrada ( <i>Knock-in</i> ) | <p>Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción podrá ser ejercida.</p> <p>Debe ser informado cuando la operación corresponda a una opción con barrera del tipo "<i>up-and-in</i>" o "<i>down-and-in</i>". En el primer caso, el precio del subyacente debe subir hasta un determinado nivel (el precio barrera de entrada) para que el derecho que confiere el instrumento se active o sea ejercido; en el segundo caso, el precio del subyacente debe bajar hasta un determinado nivel para que la opción sea válida (precio barrera de entrada).</p>      |
| 47       | Precio Barrera de Salida ( <i>Knock-out</i> ) | <p>Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción no podrá ser ejercida.</p> <p>Debe ser informado cuando la operación corresponda a una opción con barrera del tipo "<i>up-and-out</i>" o "<i>down-and-out</i>". En el primer caso, la opción solo puede ejercerse válidamente mientras el precio del subyacente no alcance un determinado nivel (el precio barrera de salida); en el segundo caso, el precio del subyacente se debe mantener sobre un determinado nivel (precio barrera de salida) para que la opción se mantenga activa o sea ejercida.</p> |
| 48       | Objetivo de la Operación                      | <p>Indicar el objetivo de la operación para la Contraparte 1, según lo indicado en la Tabla Objetivo de la Operación.</p> <p>Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá reportar esta clasificación de acuerdo a la norma sectorial correspondiente.</p>  |
| 49       | Convenio Marco                                | Indicar tipo y código único asignado al Convenio Marco de contratación de derivados, según lo indicado en la Tabla Convenio Marco.  |
| 50       | Jurisdicción del Contrato                     | Código del país correspondiente a la legislación y jurisdicción aplicable bajo la cual el Contrato está amparado, de acuerdo a la norma ISO 3166-1 alpha-3.   |
| 51       | Garantías                                     | Indicar si la operación cuenta con garantías asociadas al cumplimiento de las obligaciones que la misma comprende, según lo indicado en la Tabla de Garantías.  |



| N° Campo | Campo  | Descripción original  |
|----------|--|---|
| 52       | Cláusula de <i>Recouponing</i>                     | Indicar si la operación considera o no cláusula de <i>Recouponing</i> en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de <i>Recouponing</i> .  |
| 53       | Cláusula de Término Anticipado                     | Indicar si la operación fue pactada o no con cláusula de término (ya sea obligatoria o voluntaria) y exigibilidad anticipada de obligaciones para la Contraparte 1, Contraparte 2, o cualquiera de las partes, según Tabla Cláusula de Término Anticipado.  |
| 54       | Fecha Efectiva de Término o Liquidación Anticipada | Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.  |
| 55       | Compresión de Cartera                              | Identificar si el nuevo Contrato o el término anticipado de uno previamente informado es resultado de una compresión u optimización de cartera.   |
| 56       | Plataforma de Negociación                          | Código de la Plataforma de Negociación en la cual fue pactado el contrato de derivado, según código MIC ( <i>Market Identifier Code</i> ) de la norma ISO 10383.<br><br>En el caso que el contrato fuese negociado fuera de Bolsa, se deberá indicar en este campo el código "OTC".   |
| 57       | RUT Intermediario                                  | RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario (Broker) que actuó como intermediario en el cierre de la operación.  |
| 58       | LEI Intermediario                                  | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ), si lo tuviere, del Broker que actuó como intermediario en el cierre de la operación.   |
| 59       | Número Total de Intercambios o Flujos              | Número total de oportunidades (fechas) en las cuales pueden ocurrir liquidaciones de operaciones correspondientes a un intercambio de flujo y/o notional, los cuales deberán ser detallados a continuación.<br><br>Para un instrumento que se compone de un único intercambio o liquidación a futuro, este campo no debe ser reportado. |



| N° Campo                              | Campo  | Descripción original   |
|---------------------------------------|--|--|
| <b><u>B. Calendario de Flujos</u></b> |  |  |
| 60                                    | Número del Flujo a Recibir                             | Correlativo del número del flujo a recibir a futuro por la Contraparte 1, ya sea por intercambio del principal o pago de intereses.  |
| 61                                    | Factor sobre Tasa de Interés Variable a Recibir        | Factor que multiplica la tasa variable que recibe la Contraparte 1.  |
| 62                                    | Spread sobre Tasa de Interés Variable a Recibir        | Spread que recibe la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable.  |
| 63                                    | Tasa de Interés Fija a Recibir                         | Tasa de interés fija a recibir por la Contraparte 1.   |
| 64                                    | Fecha de <i>Fixing</i> para Tasa de Interés a Recibir  | Fecha que se considera para la tasa de interés variable de referencia utilizada en el cálculo de intereses del flujo a recibir por la Contraparte 1, según se estipule en el Contrato. |
| 65                                    | Fecha de Inicio del Flujo a Recibir                    | Fecha de inicio del período durante el cual se devengarán los intereses del flujo a recibir por la Contraparte 1.  |
| 66                                    | Fecha de Término del Flujo a Recibir                   | Fecha de término del período durante el cual se devengarán intereses para el flujo que será recibido por la Contraparte 1.   |
| 67                                    | Monto Nocional Aplicable al Flujo a Recibir            | Monto nocional que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a recibir por la Contraparte 1.  |
| 68                                    | Monto a Recibir como Intercambio del Capital           | Monto recibido por la Contraparte 1 en el flujo respectivo, producto del intercambio de capital o principal.   |
| 69                                    | Moneda del Monto a Recibir como Intercambio de Capital | Código de la moneda del monto a recibir como intercambio de capital o principal, según norma ISO 4217.   |
| 70                                    | Número del Flujo a Entregar                            | Correlativo del número del flujo a entregar a futuro por la Contraparte 1, ya sea por intercambio del principal o pago de intereses.   |
| 71                                    | Factor sobre Tasa de Interés Variable a Entregar       | Factor que multiplica la tasa variable que entrega la Contraparte 1.   |
| 72                                    | Spread sobre Tasa de Interés Variable a Entregar       | Spread bajo el cual se obliga la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable.  |





| N° Campo | Campo  | Descripción original  |
|----------|--|---|
| 73       | Tasa de Interés Fija a Entregar                          | Tasa de interés fija a entregar la Contraparte 1.   |
| 74       | Fecha de <i>Fixing</i> para Tasa de Interés a Entregar   | Fecha que se considera para la tasa de interés variable de referencia utilizada en el cálculo de intereses del flujo a entregar por la Contraparte 1, según se estipule en el Contrato. |
| 75       | Fecha Inicio del Flujo a Entregar                        | Fecha de inicio del período de tiempo durante el cual se devengarán los intereses del flujo a entregar por la Contraparte 1.  |
| 76       | Fecha de Término del Flujo a Entregar                    | Fecha de término del período durante el cual se devengarán intereses para el flujo que será entregado por la Contraparte 1.   |
| 77       | Monto Nocional Aplicable al Flujo a Entregar             | Monto nocional que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a entregar por la Contraparte 1.  |
| 78       | Monto a Entregar como Intercambio de Capital             | Monto entregado por la Contraparte 1 en el flujo respectivo, producto del intercambio de capital o principal.   |
| 79       | Moneda del Monto a Entregar como Intercambio de Nocional | Código de la moneda del monto a entregar como intercambio de capital o principal, según norma ISO 4217.   |

## Sección 2: Pagos del periodo

| N° Campo | Campo                              | Descripción   |
|----------|------------------------------------|---|
| 80       | Número Total de Registros de Pagos | Número total de registros de pagos que serán informados para la operación, los cuales deberán ser detallados a continuación.<br><br>En el caso de agrupar ( <i>netear</i> ) distintos eventos de pagos, estos deberán corresponder a un mismo tipo, de acuerdo a la Tabla Tipo de Pago Efectuado. |
| 81       | Correlativo de Registro de Pago    | Correlativo del registro de pago a informar.  |
| 82       | Fecha de Pago                      | Fecha de pago o liquidación.<br><br>En el caso de informar más de un pago como registro agrupado, indicar la fecha correspondiente al pago más reciente.  |



| N° Campo | Campo                  | Descripción   |
|----------|------------------------|---|
| 83       | Monto Pago Recibido    | <p>Monto recibido por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada.</p> <p>En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor correspondiente al pago total generado por la estructura de derivados en cada uno de los instrumentos que la componen.</p> |
| 84       | Monto Pago Entregado   | <p>Monto pagado por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada.</p> <p>En caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor correspondiente al pago total generado por la estructura de derivados en cada uno de los instrumentos que la componen.</p>      |
| 85       | Tipo de Pago Efectuado | Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado.  |

### Sección 3: Garantías

| N° Campo | Campo                                 | Descripción  |
|----------|---------------------------------------|--|
| 86       | Moneda de Valorización de la Garantía | <p>Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>  |
| 87       | Identificador de la Garantía Recibida | <p>Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas que respaldan el Contrato. Este código debe ser repetido para todas las operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a monedas y por lo tanto. informadas en otros sistemas de este RO.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p> |



| N° Campo | Campo   | Descripción   |
|----------|---|---|
| 88       | Activos de Garantía Recibida                  | <p>Porcentaje de cada tipo de activo(s) recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la obligación de la Contraparte 2 en la operación, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>   |
| 89       | Monto Umbral ("Threshold") para Contraparte 2 | <p>Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 2 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de <i>recouponing</i>. Este monto debe estar expresado en la misma moneda en la cual será informado el Valor de Mercado de la operación (Sección 4).</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>   |
| 90       | Valor de Garantía Recibida                    | <p>Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas por la Contraparte 1 en caución de las operaciones reportadas, una vez realizado los descuentos pactados aplicables ("<i>haircut</i>"). En el caso de que otras operaciones sean respaldadas por esta misma garantía o portafolio se debe repetir este valor para cada una de ellas.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>                    |
| 91       | Identificador de la Garantía Entregada        | <p>Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías entregadas que respaldan el Contrato.</p> <p>Este código debe ser repetido para todas las operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a monedas y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p> |
| 92       | Activos de Garantía Entregada                 | <p>Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>   |



| N° Campo | Campo   | Descripción  |
|----------|---|--|
| 93       | Monto Umbral ("Threshold") para Contraparte 1 | Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 1 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de <i>recouping</i> . Este monto debe estar expresado en la misma moneda en la cual será informado el Valor de Mercado de la operación (sección 4).<br><br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.  |
| 94       | Valor de Garantía Entregada                   | Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías entregadas por la Contraparte 1 en caución de las operaciones reportadas, una vez realizado los descuentos pactados aplicables (" <i>haircut</i> "). En el caso que la misma garantía o portafolio de garantías respalden otras operaciones, se debe repetir este valor para cada una de ellas.<br><br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. |

#### Sección 4: Valor de Mercado

| N° Campo | Campo                  | Descripción  |
|----------|------------------------|--|
| 95       | Método de Valorización | Indicar si la valorización fue realizada utilizando precios de mercado ( <i>mark-to-market</i> ), modelos de cálculo ( <i>mark-to-model</i> ), fue efectuada por una Entidad de Contraparte Central, conforme a la Ley N° 20.345, o a través de otro método de valorización, según lo indicado en la Tabla Método de Valorización.   |
| 96       | Moneda de Valorización | Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.   |
| 97       | Valor de Mercado       | Valor de mercado o valor razonable neto del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización.<br><br>En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen.<br><br>Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá expresar el valor de mercado en base a las normas sectoriales definidas por el supervisor respectivo. |



| N° Campo | Campo                           | Descripción   |
|----------|---------------------------------|---|
| 98       | Opciones: Volatilidad Implícita | Indicar la volatilidad implícita utilizada en la determinación del valor razonable de la opción. Cuando exista profundidad en este mercado, se reportará volatilidad implícita, en caso contrario, volatilidad histórica.   |
| 99       | Opciones: Delta                 | En este campo se informará el cambio que tendría el Valor de Mercado del Contrato (V) si el precio del subyacente (S) varía en +1% respecto de su valor vigente (Delta: $\Delta = \partial V / \partial S$ ).   |
| 100      | Opciones: Gamma                 | En este campo se informará el cambio que tendría Delta ( $\Delta$ ) si el precio del subyacente (S) varía en +1% respecto de su valor vigente (Gamma: $\Gamma = \partial \Delta / \partial S = \partial^2 V / \partial S^2$ ).  |
| 101      | Opciones: Vega                  | En este campo se informará el cambio que tendría el Valor de Mercado del Contrato (V) si la volatilidad anualizada del subyacente ( $\sigma$ ) varía en +1 punto porcentual respecto del valor utilizado en la valoración de la opción (Vega: $v = \partial V / \partial \sigma$ ). |

Adicionalmente, solo aquellos Participantes correspondientes a entidades bancarias y sus filiales deberán enviar los campos mencionados a continuación:

| N° Campo | Campo   | Descripción  |
|----------|---|--|
| 102      | Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte ( <i>Credit Value Adjustment</i> ) | Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2.<br><br>En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones respecto de la Contraparte 2, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.<br><br>En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones, asociados a dos o más Contrapartes, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo. |
| 103      | Ajuste a la Valorización por BID-OFFER Spread   | Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por BID-OFFER Spread de la cartera de contratos de derivados de monedas, para la Contraparte 1.<br><br>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.  |



| <b>N°<br/>Campo</b> | <b>Campo</b>                    | <b>Descripción</b>   |
|---------------------|---------------------------------|--|
| 104                 | Otros Ajustes a la Valorización | <p>Indicar monto de otros ajustes al Valor de Mercado Neto de la cartera de contratos de derivados de monedas de la Contraparte 1, distintos a los informados en los campos anteriores.</p> <p>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.</p> |



## SISTEMA N°2

### ESPECIFICACIONES DE LA INFORMACIÓN REQUERIDA DE “OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS SOBRE TASAS DE INTERÉS”

#### I. INSTRUCCIONES GENERALES:

La información requerida de conformidad con este Sistema deberá ser considerada por los Participantes para reportar las operaciones con Instrumentos Derivados cuyo activo subyacente corresponda a tasas de interés. Para ello se deberá enviar la información solicitada en este Sistema a la Gerencia de División Estadísticas del BCCh a través del Portal SIID ([www.siid.cl](http://www.siid.cl)) u otra dirección que el Banco pueda informar.

Las Empresas Bancarias deberán reportar hasta las 10:00 AM del día hábil bancario siguiente las Nuevas Operaciones y Modificaciones efectuadas a los Contratos. Adicionalmente, deberán enviar dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, los antecedentes de los Contratos Vigentes y Contratos Vencidos en el mes inmediatamente anterior, de acuerdo a las instrucciones contenidas en las diferentes secciones de las Especificaciones contenidas en este Sistema.

Los demás Participantes que no correspondan a Empresas bancarias, deberán reportar mensualmente dentro de los cinco primeros días hábiles bancarios de cada mes, la información de los Contratos Vigentes y Contratos Vencidos en el mes inmediatamente anterior.

#### SECCIÓN A: Información Diaria de Nuevas Operaciones, Modificaciones y Términos.

##### 1) Nuevas Operaciones

Para reportar las nuevas operaciones pactadas por los Participantes, estos deberán enviar al Banco los campos pertenecientes a la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, indicando en el campo “Evento de Reporte” alguno de los eventos detallados en el numeral “2.1 Suscripción”.

##### 2) Modificaciones de los Contratos

Los Participantes que efectúen modificaciones a sus Contratos, deberán enviar todos los campos previamente reportados actualizados, indicando como “Evento de Reporte” alguno de los señalados en el número “2.2 Modificación”.

Los campos “RUT Participante (Contraparte 1)”, “LEI Contraparte 1”, “Identificador del Contrato”, y “Fecha y hora de suscripción del Contrato” son los que permitirán identificar la operación previamente informada sobre la cual se aplicará la modificación o el término anticipado. Debido a lo anterior, dichos campos no podrán ser modificados por los Participantes.

##### 3) Términos Anticipados y Anulaciones de Contratos

En el caso de los Participantes que trasfieran a un tercero el Contrato previamente reportado, pongan término a este en una fecha anterior a lo inicialmente establecido o anulen el envío del Contrato al SIID, deberán reportar al Banco la información que aplica a los eventos de reporte “2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación”, “2.3.2 Cesión” o “2.3.3 Anulación”, según corresponda.



## SECCIÓN B: Información Mensual de Contratos Vigentes y Contratos Terminados

### 1) Contratos Vigentes

Los Participantes deberán reportar, respecto de cada Contrato Vigente al término del mes calendario, la última información disponible para los campos de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, además de los pertenecientes a las secciones 2 “Pagos”, 3 “Garantías” y 4 “Valor de Mercado”, indicando como “Evento de Reporte” la opción “2.4 Vigencia”.

La información de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación” será entendida como una confirmación sobre las condiciones vigentes del derivado al cierre del mes informado.

La información de la Sección 2 “Pagos” hará referencia a cualquier pago o intercambio de flujos originado por la operación en cuestión, efectuado durante el transcurso del mes informado.

La información de las Secciones 3 “Garantías” y 4 “Valor de Mercado” deberá ser reportada indicando las condiciones vigentes al cierre del mes informado.

### 2) Contratos Terminados

Los Participantes deberán reportar, para cada Contrato Terminado, indicando como “Evento de Reporte” la opción “2.3.4 Vencimiento”, la información vigente al momento del término de éste, completando la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación” además de la Sección 2 “Pagos”.

Se deberán incluir también mensualmente en este Evento de Reporte aquellos Contratos que fueron terminados por “2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación” o “2.3.2 Cesión”.

La información de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, será entendida como una confirmación sobre las condiciones vigentes del derivado al momento de su término.

La información reportada en la Sección 2 “Pagos” hará referencia a cualquier pago o intercambio de flujos originados por la operación en cuestión, efectuados durante el transcurso del mes informado.

En la información que se proporcione bajo juramento, referida a Contratos sobre tasas de interés, se precisará si dichos antecedentes dicen relación con el cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCFI.





## II. INFORMACIÓN SOLICITADA

### Sección 1: Condiciones Financieras de la Operación

| N° Campo                             | Campo                        | Descripción original  |
|--------------------------------------|------------------------------|---|
| <b><u>A. Información General</u></b> |                              |   |
| 1                                    | Naturaleza de la Información | Debe precisarse si los antecedentes que conforman el respectivo Evento de Reporte, se entregan o no al BCCh en cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI, sobre operaciones con instrumentos derivados.   |
| 2                                    | Evento de Reporte            | <p>Código que identifica el tipo de registro que será informado o reportado, según la Tabla Eventos de Reporte. Este podrá corresponder a:</p> <p><b>2.1 Suscripción</b></p> <p>2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante.</p> <p>2.1.2 Adquisición por cesión: Cuando el Participante asume las obligaciones y es cesionario de los derechos vinculados a un Contrato suscrito anteriormente por un tercero.</p> <p>Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la celebración de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar un evento de suscripción para cada instrumento comprendido en la estructura.</p> <p><b>2.2 Modificación</b></p> <p>Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante.</p> <p>2.2.1 <i>Recouponing</i>: Modificación de las condiciones financieras de un Contrato a consecuencia de pagos que hacen las partes con el objeto de modificar su valor razonable (<i>mark to market</i>).</p> <p>2.2.2 Modificación de contraparte por cesión: El Participante que permanece en el Contrato cedido debe informar que su contraparte ha cambiado producto de una cesión. No procederá informar como cesión la novación de las obligaciones de un Contrato producto de la compensación y liquidación de las mismas en una entidad de Entidad de Contraparte Central.</p> <p>2.2.3 Otras modificaciones: Cuando se realicen otros cambios a alguna de las condiciones financieras del Contrato y que no correspondan a una corrección de reporte, tales como: fechas de vencimiento, montos pactados, precios pactados, precios referenciales de mercado a utilizar en caso de compensación, cambios en la modalidad de entrega y liquidación, y cambios en las partes compradora o vendedora por causales distintas de cesión.</p> <p>2.2.4 Corrección de reporte: Rectificación de información enviada previamente por el Participante que no corresponda a una modificación contractual.</p> |



| N° Campo | Campo  | Descripción original   |
|----------|--|--|
|          |  | <p><b>2.3 Término</b></p> <p>Corresponde al evento de terminación o pérdida de vigencia de una operación reportada previamente por el Participante, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.</p> <p>2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación: Caducidad o término de forma anticipada del Contrato por causales contempladas en el Contrato respectivo, por causa legal, acuerdo de las partes, incluyendo la compresión u optimización de cartera.</p> <p>2.3.2 Cesión: Transferencia a un tercero de un Contrato previamente reportado por el Participante (cedente).</p> <p>2.3.3 Anulación: Eliminación de la información referida a un Contrato informado previamente, debido a que este nunca existió (ej. duplicaciones, cotizaciones, error de información, entre otros) o bien no estaba afecto a la regulación de derivados de tasas de interés del Capítulo III.D.3 del CNF y su respectivo Reglamento Operativo.</p> <p>2.3.4 Vencimiento: Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha de término del Contrato, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vencidos, junto con la información de pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior</p> <p><b>2.4 Vigencia</b></p> <p>Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha del reporte, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vigentes, junto con la información sobre valorizaciones, garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior.</p> |
| 3        | RUT Participante (Contraparte 1)                 | RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de tasas de interés (Contraparte 1).   |
| 4        | LEI Contraparte 1                                | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de tasas de interés, si lo tuviere.   |
| 5        | RUT Contraparte del Participante (Contraparte 2) | RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar.  |
| 6        | LEI Contraparte 2                                | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar, si lo tuviere.  |
| 7        | Nombre o Razón Social Contraparte 2              | Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.   |



| N° Campo | Campo   | Descripción original  |
|----------|---|---|
| 8        | País Contraparte 2  | Código del país de residencia o domicilio de la Contraparte 2, de acuerdo a la norma ISO 3166-1 alpha-3.  |
| 9        | RUT Entidad de Contraparte Central  | RUT (Rol Único Tributario) de la Entidad de Contraparte Central establecida en Chile, conforme a la Ley N°20.345, a través de la cual se haya convenido realizar la liquidación de las obligaciones correspondientes al Contrato.   |
| 10       | LEI Entidad de Contraparte Central  | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ), si lo tuviere, asignado a la Entidad de Contraparte Central a través de la cual se haya convenido realizar la liquidación de las obligaciones correspondientes al Contrato.  |
| 11       | RUT Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1 | En el caso de que un Contrato sea liquidado en una Entidad de Contraparte Central u otro agente liquidador, y que la Contraparte 1 no sea miembro de dicha entidad, se debe indicar el RUT (Rol Único Tributario) de quien opera como Participante Directo o bien como Agente Liquidador de la Contraparte 1 ante la Entidad de Contraparte Central.  |
| 12       | LEI Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1 | En el caso de que un Contrato sea liquidado en una Entidad de Contraparte Central u otro agente liquidador, y que la Contraparte 1 no sea miembro de dicha entidad, se debe indicar el Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ) asignado a la entidad que opera como Participante Directo o bien como Agente Liquidador de la Contraparte 1 ante la Entidad de Contraparte Central, si lo tuviere. |
| 13       | RUT Agente de Cálculo   | RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad que actuará como Agente de cálculo para cuando se pone término al Contrato.  |
| 14       | LEI Agente de Cálculo   | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ) , si lo tuviere, asignado a la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato   |
| 15       | Nombre o Razón Social Agente de Cálculo   | Nombre o razón social de la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato  |
| 16       | RUT del Cedente o Cesionario  | RUT (Rol Único Tributario) de la Contraparte domiciliada o residente en Chile que cede (evento suscripción 2.1.2 “Adquisición por Cesión”, evento de modificación 2.2.2 “Modificación de Contraparte por Cesión”) o a la que se cede (evento término 2.3.2 “Cesión”) un Contrato.<br><br>Las novaciones a una Cámara de Contraparte Central no se incluyen en este campo.                               |



| N° Campo | Campo   | Descripción original   |
|----------|---|--|
| 17       | LEI Cedente o Cesionario                          | <p>Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>), si lo tuviere, asignado a la Contraparte que cede (Evento Suscripción 2.1.2 “Adquisición por Cesión”, Evento de Modificación 2.2.2 “Modificación de Contraparte por Cesión”) o a la que se cede (Evento Término 2.3.2 “Cesión”) un Contrato.</p> <p>Las novaciones producto de liquidaciones en Cámara de Contraparte Central no se incluyen en este campo.</p>  |
| 18       | Identificador del Contrato                        | <p>Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (<i>Unique Transaction Identifier</i>), debe ser indicado en este campo.</p> <p>Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá informar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.</p> |
| 19       | Identificador del Contrato para Agente Autorizado | <p>Código único asignado por el Agente Autorizado a cada Contrato suscrito por el Participante.</p> <p>Este campo puede ser informado solo cuando el envío de información al SIID sea realizado por un Agente Autorizado a nombre del Participante.</p>  |
| 20       | Identificador de Operaciones Estructuradas        | <p>Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato).</p> <p>Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.</p>   |
| 21       | Instrumento                                       | <p>Tipo de instrumento al que corresponda la operación informada según la Tabla de Instrumentos.</p>   |
| 22       | Opciones: Clase                                   | <p>Clase de opción a que corresponde la operación informada, de acuerdo a la modalidad de ejercicio pactada en el Contrato, según lo señalado en la Tabla Clase de Opción.</p>   |
| 23       | Opciones: Posición en la Operación                | <p>Indicar si la Contraparte 1 asume la posición compradora o vendedora en la opción, según lo señalado en la Tabla Tipo de Posición.</p>  |
| 24       | Opciones: Instrumento Subyacente                  | <p>Indicar si el ejercicio de la opción implica la entrada en vigencia de un nuevo derivado (ejemplo <i>swaption</i>). Si este es el caso, reportar el instrumento subyacente correspondiente, según lo señalado en la Tabla de Opciones - Instrumentos Subyacentes.</p>   |



| N° Campo | Campo                                    | Descripción original  |
|----------|--|---|
| 25       | Modalidad de Liquidación                 | Modalidad estipulada en el Contrato para llevar a cabo los pagos o liquidaciones de intereses que éste origine, la cual puede ser por compensación o entrega física, según lo señalado en la Tabla Modalidad de Liquidación.  |
| 26       | Moneda de Compensación                   | Código de la moneda en la cual se realiza la compensación, según norma ISO 4217, en caso de haberse pactado dicha modalidad de liquidación.   |
| 27       | Moneda Monto Ncional                     | Código de la moneda en la que esta expresado el monto ncional sobre el cual se calculan los intereses a intercambiar, según norma ISO 4217.   |
| 28       | Monto ncional                            | Se debe indicar el monto ncional de la operación, sobre el cual se calculan los intereses. Este campo se debe completar cuando hay un único flujo.  |
| 29       | Tipo de Tasa de Interés a Recibir        | Indicar si la tasa de interés recibida por la Contraparte 1 es fija o una de tipo variable, según lo señalado en la Tabla Tipo de Tasa de Interés.  |
| 30       | Tipo de Tasa de Interés a Entregar       | Indicar si la tasa de interés entregada por la Contraparte 1 es fija o una de tipo variable, según lo señalado en la Tabla Tipo de Tasa de Interés.   |
| 31       | Fecha y Hora de Suscripción del Contrato | Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato.   |
| 32       | Fecha de Inicio                          | Fecha en la cual comienzan a devengarse los intereses de la operación en favor de alguna de las contrapartes. Este campo se debe completar cuando hay un único flujo. En el caso de haber más intercambios se debe indicar la fecha de inicio para cada uno de los flujos en la sección de calendario de pagos.   |
| 33       | Fecha de <i>Fixing</i>                   | Fecha que se considera para la tasa de interés de referencia utilizada en el cálculo del flujo, según se estipule en el Contrato.<br><br>Este campo debe ser informado cuando la operación considera un único intercambio a futuro. En el caso de haber más intercambios se debe indicar la fecha de <i>fixing</i> para cada uno de ellos en la sección de calendario de pagos. |
| 34       | Fecha de Término                         | Fecha en la cual vence o madura la operación de acuerdo a lo establecido originalmente en el Contrato. En el caso de un anticipo se debe reportar la nueva fecha de término en el campo "Fecha Efectiva de Término o Liquidación Anticipada".   |



| N° Campo | Campo  | Descripción original  |
|----------|--|---|
| 35       | Fecha de Pago de la Operación                    | Fecha de la última liquidación de la operación.   |
| 36       | Fecha de Inicio de la Modificación               | Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una modificación.  |
| 37       | Tasa de Interés Fija a Recibir                   | <p>Tasa fija a recibir por la Contraparte 1. Este campo se debe completar sólo cuando existe un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso de haber más flujos se debe indicar la tasa de interés fija a recibir en el campo 57 para cada flujo del calendario de pago.</p> <p>Para el caso de una Opción, este campo corresponde a la Tasa de interés <i>Strike</i>.</p>          |
| 38       | Tasa de Interés Fija a Entregar                  | <p>Tasa fija a entregar por la Contraparte 1. Este campo se debe completar sólo cuando existe un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso de haber más flujos se debe indicar la tasa de interés fija en el campo 64 para cada flujo del calendario de pago.</p>   |
| 39       | Spread sobre Tasa de Interés Variable a Recibir  | <p>Spread sobre la tasa variable que recibe la Contraparte 1. Este campo se debe completar sólo cuando existe un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso de haber más flujos se debe indicar el spread en el campo 56 para cada flujo del calendario de pago.</p>   |
| 40       | Spread sobre Tasa de Interés Variable a Entregar | <p>Spread sobre la tasa variable que entrega la Contraparte 1. Este campo se debe completar sólo cuando existe un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso de haber más flujos se debe indicar el spread en el campo 63 para cada flujo del calendario de pagos.</p>   |
| 41       | Moneda de Prima/Pago Inicial                     | <p>Si la operación corresponde a una Opción o involucra el pago de una prima o un monto compensatorio entre las partes al inicio, se debe indicar la moneda de dicho pago.</p> <p>En el caso de una cesión, si el Participante (Contraparte 1) ha entregado o recibido un pago debe indicar la moneda de este.</p> <p>Se debe indicar el código de la moneda, según norma ISO 4217.</p> |
| 42       | Monto Prima/Pago Inicial Recibida(o)             | <p>Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.</p>  |
| 43       | Monto Prima/Pago Inicial Entregada(o)            | <p>Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.</p>   |



| N° Campo | Campo   | Descripción original  |
|----------|---|---|
| 44       | Precio Barrera de Entrada ( <i>Knock-in</i> ) | <p>Precio del subyacente, sobre o bajo el cual una opción podrá ser ejercida.</p> <p>Debe ser informado cuando la operación corresponda a una opción con barrera del tipo "<i>up-and-in</i>" o "<i>down-and-in</i>". En el primer caso, el precio del subyacente debe subir hasta un determinado nivel (el precio barrera de entrada) para que el derecho que confiere el instrumento se active o sea ejercido; en el segundo caso, el precio del subyacente debe bajar hasta un determinado nivel para que la opción sea válida (precio barrera de entrada).</p>     |
| 45       | Precio Barrera de Salida ( <i>Knock-out</i> ) | <p>Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción no podrá ser ejercida.</p> <p>Debe ser informado cuando la operación corresponda a una opción con barrera del tipo "<i>up-and-out</i>" o "<i>down-and-out</i>". En el primer caso, la opción solo puede ejercerse válidamente mientras el precio del subyacente no alcance un determinado nivel (el precio barrera de salida); en el segundo caso, el precio del subyacente se debe mantener sobre un determinado nivel (precio barrera de salida) para que la opción se mantenga activa o sea ejercida.</p> |
| 46       | Objetivo de la Operación                      | <p>Indicar el objetivo de la operación para la Contraparte 1, según lo indicado en la Tabla de Objetivo de la Operación.</p> <p>Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá reportar esta clasificación de acuerdo a la norma sectorial correspondiente.</p>   |
| 47       | Convenio Marco                                | <p>Indicar tipo y código único asignado al Convenio Marco de contratación de derivados, según lo indicado en la Tabla Convenio Marco.</p>   |
| 48       | Jurisdicción del Contrato                     | <p>Código del país correspondiente a la legislación y jurisdicción aplicable bajo la cual el Contrato está amparado, de acuerdo a la norma ISO 3166-1 alpha-3.</p>  |
| 49       | Garantías                                     | <p>Indicar si la operación cuenta con garantías asociadas al cumplimiento de las obligaciones que la misma comprende, según lo indicado en la Tabla de Garantías.</p>   |
| 50       | Cláusula de <i>Recouping</i>                  | <p>Indicar si la operación considera o no cláusula de <i>Recouping</i> en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de <i>Recouping</i>.</p>  |
| 51       | Cláusula de Término Anticipado                | <p>Indicar si la operación fue pactada o no con cláusula de término (ya sea obligatoria o voluntaria) y exigibilidad anticipada de obligaciones para la Contraparte 1, Contraparte 2, o cualquiera de las partes, según Tabla Cláusula de Término Anticipado.</p>   |



| N° Campo                              | Campo   | Descripción original  |
|---------------------------------------|---|---|
| 52                                    | Fecha de Efectiva de Término o Liquidación Anticipada | Fecha acordada para realizar la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.   |
| 53                                    | Compresión de Cartera                                 | Identificar si el nuevo Contrato o el término anticipado de uno previamente informado es resultado de una compresión u optimización de cartera.   |
| 54                                    | Plataforma de Negociación                             | Código de la Plataforma de Negociación en la cual fue pactado el contrato de derivado, según código MIC ( <i>Market Identifier Code</i> ) de la norma ISO 10383.<br><br>En el caso que el contrato fuese negociado fuera de Bolsa, se deberá indicar en este campo el código "OTC".   |
| 55                                    | RUT Intermediario                                     | RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario Broker que actuó como intermediario en el cierre de la operación.  |
| 56                                    | LEI Intermediario                                     | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ), si lo tuviere, del Broker que actuó como intermediario en el cierre de la operación.   |
| 57                                    | Número Total de Intercambios o Flujos                 | Número total de oportunidades (fechas) en las cuales pueden ocurrir liquidaciones de operaciones correspondientes a un intercambio de flujo y/o notional, los cuales deberán ser detallados a continuación.<br><br>Para un instrumento que se compone de un único intercambio o liquidación a futuro, este campo no debe ser reportado. |
| <b><u>B. Calendario de Flujos</u></b> |   |   |
| 58                                    | Número del Flujo a Recibir                            | Correlativo del número del flujo a recibir a futuro por la Contraparte 1, ya sea por intercambio del principal o pago de intereses.   |
| 59                                    | Factor sobre Tasa de Interés Variable a Recibir       | Factor que multiplica la tasa variable que recibe la Contraparte 1.   |
| 60                                    | Spread sobre Tasa de Interés Variable a Recibir       | Spread que recibe la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable.   |
| 61                                    | Tasa de Interés Fija a Recibir                        | Tasa de interés fija a recibir por la Contraparte 1.  |
| 62                                    | Fecha de <i>Fixing</i> para Tasa de Interés a Recibir | Fecha que se considera para la tasa de interés variable de referencia utilizada en el cálculo de intereses del flujo a recibir por la Contraparte 1, según se estipule en el Contrato.  |





| N° Campo | Campo  | Descripción original  |
|----------|--|---|
| 63       | Fecha de Inicio del Flujo a Recibir              | Fecha de inicio del período durante el cual se devengarán los intereses del flujo a recibir por la Contraparte 1.   |
| 64       | Fecha de Término del Flujo a Recibir             | Fecha de término del período durante el cual se devengarán intereses para el flujo que será recibido por la Contraparte 1.  |
| 65       | Monto Nocional Aplicable al Flujo a Recibir      | Monto nocional que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a recibir por la Contraparte 1.   |
| 66       | Monto a Recibir como Intercambio del Capital     | Monto recibido por la Contraparte 1 en el flujo respectivo, producto del intercambio del capital o principal.   |
| 67       | Número del Flujo a Entregar                      | Correlativo del número del flujo a entregar a futuro por la Contraparte 1, ya sea por intercambio del principal o pago de intereses.  |
| 68       | Factor sobre Tasa de Interés Variable a Entregar | Factor que multiplica la tasa variable que entrega la Contraparte 1.  |
| 69       | Spread sobre Tasa de Interés Variable a Entregar | Spread que entrega la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable.  |
| 70       | Tasa de Interés Fija a Entregar                  | Tasa de interés fija a entregar por la Contraparte 1.   |
| 71       | Fecha de Fixing para Tasa de Interés a Entregar  | Fecha que se considera para la tasa de interés variable de referencia utilizada en el cálculo de intereses del flujo a entregar por la Contraparte 1, según se estipule en el Contrato. |
| 72       | Fecha Inicio Flujo a Entregar                    | Fecha de inicio del período durante el cual se devengarán los intereses del flujo a entregar por la Contraparte 1.  |
| 73       | Fecha de Término del Flujo a Entregar            | Fecha de término del período durante el cual se devengarán intereses para el flujo que será entregado por la Contraparte 1.   |
| 74       | Monto Nocional Aplicable al Flujo a Entregar     | Monto nocional que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a entregar por la Contraparte 1.  |
| 75       | Monto a Entregar como Intercambio del Capital    | Monto entregado por la Contraparte 1 en el flujo respectivo, producto del intercambio del capital o principal.  |



## Sección 2: Pagos del periodo

| N° Campo | Campo                              | Descripción  |
|----------|------------------------------------|--|
| 76       | Número Total de Registros de Pagos | <p>Número total de registros de pagos que serán informados para la operación, los cuales deberán ser detallados a continuación.</p> <p>En el caso de agrupar (<i>netear</i>) distintos eventos de pagos, estos deberán corresponder a un mismo tipo de acuerdo a la Tabla Tipo de Pago Efectuado.</p>  |
| 77       | Correlativo de Registro de Pago    | Correlativo del registro de pago a informar.   |
| 78       | Fecha de Pago                      | <p>Fecha de pago o liquidación.</p> <p>En el caso de informar más de un pago como registro agrupado, indicar la fecha correspondiente al pago más reciente.</p>  |
| 79       | Monto Pago Recibido                | <p>Monto recibido por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada.</p> <p>En caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor correspondiente al pago total generado por la estructura de derivados en cada uno de los instrumentos que la componen.</p> |
| 80       | Monto Pago Entregado               | <p>Monto pagado por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada.</p> <p>En caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor correspondiente al pago total generado por la estructura de derivados en cada uno de los instrumentos que la componen.</p>   |
| 81       | Tipo de Pago Efectuado             | Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado.   |



### Sección 3: Garantías

| N° Campo | Campo   | Descripción  |
|----------|---|--|
| 82       | Moneda de Valorización de Garantía            | <p>Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217.</p> <p>En caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>   |
| 83       | Identificador de la Garantía Recibida         | <p>Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas que respaldan el Contrato de derivado.</p> <p>Este código debe ser repetido para todas las eventuales operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a tasas de interés y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p> |
| 84       | Activos de Garantía Recibida                  | <p>Porcentaje de cada tipo de activo(s) recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la obligación de la Contraparte 2 en la operación, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>  |
| 85       | Monto Umbral ("Threshold") para Contraparte 2 | <p>Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 2 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de <i>recouping</i>. Este monto debe estar expresado en la misma moneda en la cual será informado el Valor de Mercado de la operación (Sección 4).</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>  |



| N° Campo | Campo   | Descripción   |
|----------|---|---|
| 86       | Valor Recibida Garantía                       | <p>Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas por la Contraparte 1 como caución de las operaciones reportadas, una vez realizado los descuentos pactados aplicables (“haircut”). En el caso de que otras operaciones sean respaldadas por esta misma garantía o portafolio se debe repetir este valor para cada una de ellas.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>   |
| 87       | Identificador de la Garantía Entregada        | <p>Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías entregadas que respaldan el Contrato de derivado.</p> <p>Este código debe ser repetido para todas las eventuales operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a tasas de interés y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p> |
| 88       | Activos de Garantía Entregada                 | <p>Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>   |
| 89       | Monto Umbral (“Threshold”) para Contraparte 1 | <p>Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 1 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de <i>recouponing</i>. Este monto debe estar expresado en la misma moneda en la cual será informado el Valor de Mercado de la operación (sección 4).</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>   |
| 90       | Valor de Garantía Entregada                   | <p>Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías constituidas por la Contraparte 1 en caución de las operaciones reportadas, una vez realizado los descuentos pactados aplicables (“haircut”). En el caso que la misma garantía o portafolio de garantías respalden otras operaciones, se debe repetir este valor para cada una de ellas.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>  |



#### Sección 4: Valor de Mercado

| N° Campo | Campo                           | Descripción   |
|----------|---------------------------------|---|
| 91       | Método de Valorización          | Indicar si la valorización fue realizada utilizando precios de mercado ( <i>mark-to-market</i> ), modelos de cálculo ( <i>mark-to-model</i> ), fue efectuada por una Entidad de Contraparte Central, conforme a la Ley N° 20.345, o a través de otro método de valorización, según lo indicado en la Tabla Método de Valorización.  |
| 92       | Moneda de Valorización          | Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.  |
| 93       | Valor de Mercado                | Valor de mercado o valor razonable neto del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando.<br><br>Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización.<br><br>En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen.<br><br>Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá expresar el valor de mercado en base a las normas sectoriales definidas por el supervisor respectivo. |
| 94       | Opciones: Volatilidad Implícita | Indicar la volatilidad implícita utilizada en la determinación del valor razonable de la opción. Cuando exista profundidad en este mercado, se reportará volatilidad implícita, en caso contrario, volatilidad histórica.   |
| 95       | Opciones: Delta                 | En este campo se informará el cambio que tendría el Valor de Mercado del Contrato ( $V$ ) si la tasa de interés subyacente ( $i$ ) varía en +1 punto base respecto de su valor vigente (Delta: $\Delta = \partial V / \partial i$ ).  |
| 96       | Opciones: Gamma                 | En este campo se informará el cambio que tendría Delta ( $\Delta$ ) si la tasa de interés subyacente ( $i$ ) varía en +1 punto base respecto de su valor vigente (Gamma: $\Gamma = \partial \Delta / \partial i = \partial^2 V / \partial i^2$ ).   |
| 97       | Opciones: Vega                  | En este campo se informará el cambio que tendría el de Valor de Mercado del Contrato ( $V$ ) si la volatilidad anualizada del subyacente ( $\sigma$ ) varía en +1 punto porcentual respecto del valor utilizado en la valoración de la opción (Vega: $v = \partial V / \partial \sigma$ ).  |



Adicionalmente, solo aquellos participantes correspondientes a entidades bancarias y sus filiales deberán enviar los campos mencionados a continuación:

| N° Campo | Campo  | Descripción   |
|----------|--|---|
| 98       | Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte<br>( <i>Credit Value Adjustment</i> ) | <p>Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2.</p> <p>En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones respecto de la Contraparte 2, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.</p> <p>En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones, asociados a dos o más Contrapartes, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.</p> |
| 99       | Ajuste a la Valorización por BID-OFFER Spread  | <p>Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por BID-OFFER Spread de la cartera de contratos de derivados de tasas de interés, para la Contraparte 1.</p> <p>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.</p>   |
| 100      | Otros Ajustes a la Valorización  | <p>Indicar monto de otros ajustes al Valor de Mercado Neto de la cartera de contratos de derivados de tasas de interés de la Contraparte 1, distintos a los informados en los campos anteriores.</p> <p>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.</p>   |



## SISTEMA N°3

### ESPECIFICACIONES DE LA INFORMACIÓN REQUERIDA DE “OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS SOBRE RENTA FIJA”

#### I. INSTRUCCIONES GENERALES:

La información requerida de conformidad con este Sistema deberá ser considerada por los Participantes para reportar las operaciones con instrumentos derivados cuyo activo subyacente corresponda a renta fija. Para ello se deberá enviar la información solicitada en este Sistema a la Gerencia de División Estadísticas del BCCh a través del Portal SIID ([www.siid.cl](http://www.siid.cl)) u otra dirección que el Banco pueda informar.

Las Empresas bancarias deberán reportar hasta las 10:00 AM del día hábil bancario siguiente las Nuevas Operaciones y Modificaciones efectuadas a los Contratos. Adicionalmente, deberán enviar dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, los antecedentes de los Contratos Vigentes y Contratos Vencidos en el mes inmediatamente anterior, de acuerdo a las instrucciones contenidas en las diferentes secciones de las Especificaciones contenidas en este Sistema.

f

Los demás Participantes que no correspondan a Empresas Bancarias, deberán reportar mensualmente dentro de los cinco primeros días hábiles bancarios de cada mes la información de los Contratos Vigentes y Contratos Vencidos en el mes inmediatamente anterior.

#### SECCIÓN A: Información Diaria de Nuevas Operaciones, Modificaciones y Términos.

##### 1) Nuevas Operaciones

Para reportar las nuevas operaciones pactadas por los Participantes, estos deberán enviar al Banco los campos pertenecientes a la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, indicando en el campo “Evento de Reporte” alguno de los eventos detallados en el numeral “2.1 Suscripción”.

##### 2) Modificaciones de los Contratos

Los Participantes que efectúen modificaciones a sus Contratos, deberán enviar todos los campos previamente reportados actualizados, indicando como “Evento de Reporte” alguno de los señalados en el número “2.2 Modificación”.

Los campos “RUT Participante (Contraparte 1)”, “LEI Contraparte 1”, “Identificador del Contrato”, y “Fecha y hora de suscripción del Contrato” son los que permitirán identificar la operación previamente informada sobre la cual se aplicará la modificación o el término anticipado. Debido a lo anterior, dichos campos no podrán ser modificados por los Participantes.

##### 3) Términos Anticipados y Anulaciones de Contratos

En el caso de los Participantes que trasfieran a un tercero el Contrato previamente reportado, pongan término a este en una fecha anterior a lo inicialmente establecido o anulen el envío del Contrato al SIID, deberán reportar al Banco la información que aplica a los eventos de reporte “2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación”, “2.3.2 Cesión” o “2.3.3 Anulación”, según corresponda.



## SECCIÓN B: Información Mensual de Contratos Vigentes y Contratos Terminados

### 1) Contratos Vigentes

Los ParticipanteParticipantes deberán reportar, respecto de cada Contrato Vigente al término del mes calendario, la última información disponible para los campos de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, además de los pertenecientes a las secciones 2 “Pagos”, 3 “Garantías” y 4 “Valor de Mercado”, indicando como “Evento de Reporte” la opción “2.4 Vigencia”.

La información de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación” será entendida como una confirmación sobre las condiciones vigentes del derivado al cierre del mes informado.

La información de la Sección 2 “Pagos” hará referencia a cualquier pago o intercambio de flujos originado por la operación en cuestión, efectuado durante el transcurso del mes informado.

La información de las Secciones 3 “Garantías” y 4 “Valor de Mercado” deberá ser reportada indicando las condiciones vigentes al cierre del mes informado.

### 2) Contratos Terminados

Los ParticipanteParticipantes deberán reportar, para cada Contrato Terminado indicando como “Evento de Reporte” la opción “2.3.4 Vencimiento”, la información vigente al momento del término de éste, completando la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación” además de la Sección 2 “Pagos”.

Se deberán incluir también mensualmente en este Evento de Reporte aquellos Contratos que fueron terminados por “2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación” o “2.3.2 Cesión”.

La información de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, será entendida como una confirmación sobre las condiciones vigentes del derivado al momento de su término.

La información reportada en la Sección 2 “Pagos”, hará referencia a cualquier pago o intercambio de flujos originados por la operación en cuestión, efectuados durante el transcurso del mes informado.

En la información que se proporcione bajo juramento, referida a Contratos sobre renta fija, se precisará si dichos antecedentes dicen relación con el cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI.





## II. INFORMACIÓN SOLICITADA

### Sección 1: Condiciones Financieras de la Operación

| N° Campo                             | Campo                        | Descripción   |
|--------------------------------------|------------------------------|---|
| <b><u>A. Información General</u></b> |                              |   |
| 1                                    | Naturaleza de la información | Debe precisarse si los antecedentes que conforman el respectivo Evento de Reporte, se entregan o no al BCCh en cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI, sobre operaciones con instrumentos derivados.   |
| 2                                    | Evento de Reporte            | <p>Código que identifica el tipo de registro que será informado o reportado, según la Tabla Eventos de Reporte. Este podrá corresponder a:</p> <p><b>2.1 Suscripción</b></p> <p>2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante.</p> <p>2.1.2 Adquisición por cesión: Cuando el Participante asume las obligaciones y es cesionario de los derechos vinculados a un Contrato suscrito anteriormente por un tercero.</p> <p>Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la celebración de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar un evento de suscripción para cada instrumento comprendido en la estructura.</p> <p><b>2.2 Modificación</b></p> <p>Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante.</p> <p>2.2.1 <i>Recouponing</i>: Modificación de las condiciones financieras de un Contrato a consecuencia de pagos que hacen las partes con el objeto de modificar su valor razonable (<i>mark to market</i>).</p> <p>2.2.2 Modificación de contraparte por cesión: El Participante que permanece en el Contrato cedido debe informar que su contraparte ha cambiado producto de una cesión. No procederá informar como cesión la novación de las obligaciones de un Contrato producto de la compensación y liquidación de las mismas en una entidad de Entidad de Contraparte Central.</p> <p>2.2.3 Otras modificaciones: Cuando se realicen otros cambios a alguna de las condiciones financieras del Contrato y que no correspondan a una corrección de reporte, tales como: fechas de vencimiento, montos pactados, precios pactados, precios referenciales de mercado a utilizar en caso de compensación, cambios en la modalidad de entrega y liquidación, y cambios en las partes compradora o vendedora por causales distintas de cesión.</p> <p>2.2.4 Corrección de reporte: Rectificación de información enviada previamente por el Participante que no corresponda a una modificación contractual.</p> |



| N° Campo | Campo  | Descripción   |
|----------|--|---|
|          |  | <p><b>2.3 Término</b></p> <p>Corresponde al evento de terminación o pérdida de vigencia de una operación reportada previamente por el Participante, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.</p> <p>2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación: Caducidad o término de forma anticipada del Contrato por causales contempladas en el Contrato respectivo, por causa legal, acuerdo de las partes, incluyendo la compresión u optimización de cartera.</p> <p>2.3.2 Cesión: Transferencia a un tercero de un Contrato previamente reportado por el Participante (cedente).</p> <p>2.3.3 Anulación: Eliminación de la información referida a un Contrato informado previamente, debido a que este nunca existió (ej. duplicaciones, cotizaciones, error de información, entre otros) o bien no estaba afecto a la regulación de derivados de renta fija del Capítulo III.D.3 del CNF y su respectivo Reglamento Operativo.</p> <p>2.3.4 Vencimiento: Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha de término del Contrato, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vencidos, junto con la información de pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior.</p> <p><b>2.4 Vigencia</b></p> <p>Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha del reporte, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vigentes, junto con la información sobre valorizaciones, garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior.</p> |
| 3        | RUT Participante (Contraparte 1)                 | RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de renta fija (Contraparte 1).  |
| 4        | LEI Contraparte 1                                | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de renta fija, si lo tuviere.  |
| 5        | RUT Contraparte del Participante (Contraparte 2) | RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar.   |
| 6        | LEI Contraparte 2                                | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar, si lo tuviere.   |
| 7        | Nombre o Razón Social Contraparte 2              | Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.  |



| N° Campo | Campo   | Descripción   |
|----------|---|---|
| 8        | País Contraparte 2  | Código del país de residencia o domicilio de la Contraparte 2, de acuerdo a la norma ISO 3166-1 alpha-3.  |
| 9        | RUT Entidad de Contraparte Central  | RUT (Rol Único Tributario) de la Entidad de Contraparte Central establecida en Chile, conforme a la Ley N° 20.345, a través de la cual se haya convenido realizar la liquidación de las obligaciones correspondientes al Contrato.  |
| 10       | LEI Entidad de Contraparte Central  | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ), si lo tuviere, asignado a la Entidad de Contraparte Central a través de la cual se haya convenido realizar la liquidación de las obligaciones correspondientes al Contrato.  |
| 11       | RUT Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1 | En el caso de que un Contrato sea liquidado en una Entidad de Contraparte Central u otro agente liquidador, y que la Contraparte 1 no sea miembro de dicha entidad, se debe indicar el RUT (Rol Único Tributario) de quien opera como Participante Directo o bien como Agente Liquidador de la Contraparte 1 ante la Entidad de Contraparte Central.  |
| 12       | LEI Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1 | En el caso de que un Contrato sea liquidado en una Entidad de Contraparte Central u otro agente liquidador, y que la Contraparte 1 no sea miembro de dicha entidad, se debe indicar el Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ) asignado a la entidad que opera como Participante Directo o bien como Agente Liquidador de la Contraparte 1 ante la Entidad de Contraparte Central, si lo tuviere. |
| 13       | RUT Agente de Cálculo   | RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad que actuará como Agente de cálculo para cuando se pone término al Contrato.  |
| 14       | LEI Agente de Cálculo   | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ) , si lo tuviere, asignado a la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato.  |
| 15       | Nombre o Razón Social Agente de Cálculo   | Nombre o razón social de la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato  |
| 16       | RUT del Cedente o Cesionario  | RUT (Rol Único Tributario) de la Contraparte domiciliada o residente en Chile que cede (evento suscripción 2.1.2 “Adquisición por Cesión”, evento de modificación 2.2.2 “Modificación de Contraparte por Cesión”) o a la que se cede (evento término 2.3.2 “Cesión”) un Contrato.<br><br>Las novaciones a una Cámara de Contraparte Central no se incluyen en este campo.                               |



| N° Campo | Campo   | Descripción   |
|----------|---|---|
| 17       | LEI Cedente o Cesionario                                  | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ), si lo tuviere, asignado a la Contraparte que cede (Evento Suscripción 2.1.2 “Adquisición por Cesión”, Evento de Modificación 2.2.2 “Modificación de Contraparte por Cesión”) o a la que se cede (Evento Término 2.3.2 “Cesión”) un Contrato.<br><br>Las novaciones a una Cámara de Contraparte Central no se incluyen en este campo. |
| 18       | Identificador del Contrato                                | Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI ( <i>Unique Transaction Identifier</i> ), debe ser indicado en este campo.   |
| 19       | Identificador del Contrato para Agente Autorizado         | Código único asignado por el Agente Autorizado a cada Contrato suscrito por el Participante.<br><br>Este campo puede ser informado solo cuando el envío de información al SIID sea realizado por un Agente Autorizado a nombre del Participante.  |
| 20       | Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente | Tipo de identificador del activo de renta fija de acuerdo a lo indicado en la Tabla Tipo de Código de Activo Subyacente. Se debe utilizar de preferencia el código ISIN.  |
| 21       | Identificador del Activo Subyacente                       | Código único de identificación del activo subyacente, según nomenclatura declarada en el campo “Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente”.   |
| 22       | Tasa Pactada  | Tasa pactada a futuro del activo de renta fija. Para el caso de una opción este campo corresponde a la <i>Tasa Strike</i> .   |
| 23       | Precio Pactado  | Precio pactado a futuro del activo de renta fija. Para el caso de una opción, este campo corresponde al <i>Precio Strike</i> .  |
| 24       | Posición de la Operación                                  | Indicar si la Contraparte 1 asume la posición compradora o vendedora sobre el instrumento de renta fija, cuando se utiliza un instrumento distinto de una opción, según lo señalado en la Tabla Tipo de Posición.   |
| 25       | Instrumento   | Tipo de instrumento al que corresponda la operación informada según la Tabla de Instrumentos.   |
| 26       | Opciones: Clase   | Clase de opción a que corresponde la operación informada, de acuerdo a la modalidad de ejercicio pactada en el Contrato, según lo señalado en la Tabla Clase de Opción.   |



| N° Campo | Campo                                    | Descripción   |
|----------|--|---|
| 27       | Opciones: Posición en la Operación       | Indicar si la Contraparte 1 asume la posición compradora o vendedora en la opción, según lo señalado en la Tabla Tipo de Posición.  |
| 28       | Modalidad de Liquidación                 | Modalidad estipulada en el Contrato para llevar a cabo los pagos o liquidaciones que éste origine, la cual puede ser por compensación o entrega física, según lo señalado en la Tabla Modalidad de Liquidación.   |
| 29       | Moneda de Compensación                   | Código de la moneda en la cual se realiza la compensación, según norma ISO 4217, en caso de haberse pactado dicha modalidad de liquidación.   |
| 30       | Moneda Monto Ncional                     | Código de la moneda en la que está expresado el monto ncional sobre el cual se calculan los flujos a intercambiar, según norma ISO 4217.  |
| 31       | Monto Ncional                            | Se debe indicar el monto ncional de la operación.   |
| 32       | Fecha y Hora de Suscripción del Contrato | Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato.   |
| 33       | Fecha de Inicio                          | Fecha en la cual comienzan a devengarse los intereses de la operación en favor de alguna de las contrapartes. Este campo se debe completar cuando hay un único flujo. En el caso de haber más intercambios se debe indicar la fecha de inicio para cada uno de los flujos en la sección de calendario de pagos. |
| 34       | Fecha de <i>Fixing</i>                   | Fecha que se considera para la tasa de rendimiento o precio de referencia utilizada en el cálculo del flujo, según se estipule en el Contrato.  |
| 35       | Fecha de Término                         | Fecha en la cual vence o madura la operación de acuerdo a lo establecido originalmente en el Contrato. En el caso de un anticipo se debe reportar la nueva fecha de término en el campo "Fecha Efectiva de Término o Liquidación Anticipada".   |
| 36       | Fecha de Pago de la Operación            | Fecha de la última liquidación de la operación.   |
| 37       | Fecha de Inicio de la Modificación       | Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una modificación.  |



| N° Campo | Campo  | Descripción   |
|----------|--|---|
| 38       | Moneda de Prima/Pago Inicial                       | Si la operación corresponde a una Opción o involucra el pago de una prima o un monto compensatorio entre las partes al inicio, se debe indicar la moneda de dicho pago.<br><br>En el caso de una cesión, si el Participante (Contraparte 1) ha entregado o recibido un pago debe indicar la moneda de este.<br><br>Se debe indicar el código de la moneda según norma 4217. |
| 39       | Monto Prima/Pago Inicial Recibida(o)               | Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.   |
| 40       | Monto Prima/Pago Inicial Entregada(o)              | Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.  |
| 41       | Objetivo de la Operación                           | Indicar el objetivo de la operación para la Contraparte 1, según lo indicado en la Tabla de Objetivo de la Operación.<br><br>Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá reportar esta clasificación de acuerdo a la norma sectorial correspondiente   |
| 42       | Convenio Marco                                     | Indicar tipo y código único asignado al Convenio Marco de contratación de derivados, según lo indicado en la Tabla Convenio Marco.  |
| 43       | Jurisdicción del Contrato                          | Código del país correspondiente a la legislación y jurisdicción aplicable bajo la cual el Contrato está amparado, de acuerdo a la norma ISO 3166-1 alpha-3.   |
| 44       | Garantías  | Indicar si la operación cuenta con garantías asociadas al cumplimiento de las obligaciones que la misma comprende, según lo indicado en la Tabla de Garantías.  |
| 45       | Cláusula de <i>Recouping</i>                       | Indicar si la operación considera o no cláusula de <i>Recouping</i> en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de <i>Recouping</i> .  |
| 46       | Cláusula de Término Anticipado                     | Indicar si la operación fue pactada o no con cláusula de término (ya sea obligatoria o voluntaria) y exigibilidad anticipada de obligaciones para la Contraparte 1, Contraparte 2, o cualquiera de las partes, según Tabla Cláusula de Término Anticipado.  |
| 47       | Fecha Efectiva de Término o Liquidación Anticipada | Fecha acordada para realizar la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.   |



| N° Campo | Campo                     | Descripción   |
|----------|---------------------------|---|
| 48       | Compresión de Cartera     | Identificar si el nuevo Contrato o el término anticipado de uno previamente informado es resultado de una compresión u optimización de cartera.   |
| 49       | Plataforma de Negociación | Código de la Plataforma de Negociación en la cual fue pactado el contrato de derivado, según código MIC ( <i>Market Identifier Code</i> ) de la norma ISO 10383.<br><br>En el caso que el contrato fuese negociado fuera de Bolsa, se deberá indicar en este campo el código "OTC". |
| 50       | RUT Intermediario         | RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario Broker que actuó como intermediario en el cierre de la operación.  |
| 51       | LEI Intermediario         | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ), si lo tuviere, del Broker que actuó como intermediario en el cierre de la operación.   |

## Sección 2: Pagos del periodo

| N° Campo | Campo                              | Descripción   |
|----------|------------------------------------|---|
| 52       | Número Total de Registros de Pagos | Número total de registros de pagos que serán informados para la operación, los cuales deberán ser detallados a continuación.<br><br>En el caso de agrupar ( <i>netear</i> ) distintos eventos de pagos, estos deberán corresponder a un mismo tipo de acuerdo a la Tabla de Pago Efectuado. |
| 53       | Correlativo de Registro de Pago    | Correlativo del registro de pago a informar.  |
| 54       | Fecha de Pago                      | Fecha de pago o liquidación.<br><br>En el caso de informar más de un pago como registro agrupado, indicar la fecha correspondiente al pago más reciente último realizado.   |
| 55       | Monto Pago Recibido                | Monto recibido por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada.  |
| 56       | Monto Pago Entregado               | Monto pagado por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada.  |
| 57       | Tipo de Pago Efectuado             | Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado.  |



### Sección 3: Garantías

| N° Campo | Campo   | Descripción   |
|----------|---|---|
| 58       | Moneda de Valorización de Garantía            | <p>Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217.</p> <p>En caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>  |
| 59       | Identificador de la Garantía Recibida         | <p>Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas que respaldan el Contrato.</p> <p>Este código debe ser repetido para todas las eventuales operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a renta fija y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p> |
| 60       | Activos de Garantía Recibida                  | <p>Porcentaje de cada tipo de activo(s) recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la obligación de la Contraparte 2 en la operación, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>   |
| 61       | Monto Umbral ("Threshold") para Contraparte 2 | <p>Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 2 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de <i>recouping</i>. Este monto debe estar expresado en la misma moneda en la cual será informado el Valor de Mercado de la operación (Sección 4).</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>   |
| 62       | Valor Garantía Recibida                       | <p>Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas por la Contraparte 1 como caución de las operaciones reportadas, una vez realizado los descuentos pactados aplicables ("<i>haircut</i>"). En el caso de que otras operaciones sean respaldadas por esta misma garantía o portafolio se debe repetir este valor para cada una de ellas.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>                        |





| N° Campo | Campo   | Descripción   |
|----------|---|---|
| 63       | Identificador de la Garantía Entregada        | <p>Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías entregadas que respaldan el Contrato de derivado.</p> <p>Este código debe ser repetido para todas las eventuales operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a renta fija y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p> |
| 64       | Activos de Garantía Entregada                 | <p>Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>   |
| 65       | Monto Umbral ("Threshold") para Contraparte 1 | <p>Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 1 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de <i>recouping</i>. Este monto debe estar expresado en la misma moneda en la cual será informado el Valor de Mercado de la operación (Sección 4).</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>   |
| 66       | Valor de Garantía Entregada                   | <p>Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías constituidas por la Contraparte 1 como caución de las operaciones reportadas, una vez realizado los descuentos pactados aplicables ("<i>haircut</i>"). En el caso que la misma garantía o portafolio de garantías respalden otras operaciones, se debe repetir este valor para cada una de ellas.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>   |



#### Sección 4: Valor de Mercado

| N° Campo | Campo                           | Descripción  |
|----------|---------------------------------|--|
| 67       | Método de Valorización          | Indicar si la valorización fue realizada utilizando precios de mercado ( <i>mark-to-market</i> ), modelos de cálculo ( <i>mark-to-model</i> ), fue efectuada por una Entidad de Contraparte Central, conforme a la Ley N° 20.345, o a través de otro método de valorización, según lo indicado en la Tabla Método de Valorización.   |
| 68       | Moneda de Valorización          | Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.   |
| 69       | Valor de Mercado                | Valor de mercado o valor razonable neto del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando.<br><br>Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización.<br><br>Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá expresar el valor de mercado en base a las normas sectoriales definidas por el supervisor respectivo. |
| 70       | Opciones: Volatilidad Implícita | Indicar la volatilidad implícita utilizada en la determinación del valor razonable de la opción. Cuando exista profundidad en este mercado, se reportará volatilidad implícita, en caso contrario, volatilidad histórica.  |
| 71       | Opciones: Delta                 | En este campo se informará el cambio que tendría el Valor de Mercado del Contrato ( $V$ ) si el precio del subyacente ( $S$ ) varía en +1% respecto de su valor vigente (Delta: $\Delta = \partial V / \partial S$ ).  |
| 72       | Opciones: Gamma                 | En este campo se informará el cambio que tendría Delta ( $\Delta$ ) si el precio del subyacente ( $S$ ) varía en +1% respecto de su valor vigente (Gamma: $\Gamma = \partial \Delta / \partial S = \partial^2 V / \partial S^2$ ).   |
| 73       | Opciones: Vega                  | En este campo se informará el cambio que tendría el Valor de Mercado del Contrato ( $V$ ) si la volatilidad anualizada del subyacente ( $\sigma$ ) varía en +1 punto porcentual respecto del valor utilizado en la valoración de la opción (Vega: $v = \partial V / \partial \sigma$ ).  |



Adicionalmente, solo aquellos participantes correspondientes a entidades bancarias y sus filiales deberán enviar los campos mencionados a continuación:

| N° Campo | Campo  | Descripción   |
|----------|--|---|
| 74       | Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte<br>( <i>Credit Value Adjustment</i> ) | <p>Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2.</p> <p>En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones respecto de la Contraparte 2, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.</p> <p>En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones, asociados a dos o más Contrapartes, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.</p> |
| 75       | Ajuste a la Valorización por BID-OFFER Spread  | <p>Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por BID-OFFER Spread de la cartera de contratos de derivados de renta fija, para la Contraparte 1.</p> <p>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.</p>   |
| 76       | Otros Ajustes a la Valorización  | <p>Indicar monto de otros ajustes al Valor de Mercado Neto de la cartera de contratos de derivados de renta fija de la Contraparte 1, distintos a los informados en los campos anteriores.</p> <p>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.</p>   |



## ANEXO N° 1

### **SOLICITUD DE ACCESO PARA REMITIR LA INFORMACIÓN REQUERIDA AL SISTEMA INTEGRADO DE INFORMACIÓN SOBRE TRANSACCIONES DE DERIVADOS (SIID) DEL BANCO CENTRAL DE CHILE**

\_\_\_\_\_ de \_\_\_\_\_ de 20 \_\_\_\_\_.

Sres.

[ \_\_\_\_\_ ]

Banco Central de Chile

Presente

Por medio del presente instrumento, [ \_\_\_\_\_ ], en adelante “el Participante”, solicita al Banco Central de Chile (BCCh o Banco) su autorización para remitir la información requerida al Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (SIID) administrado por el BCCh. Lo anterior, de acuerdo con la normativa que actualmente se encuentra contenida en el Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras (CNF), su Reglamento Operativo, y las modificaciones que en el futuro pueda introducir el BCCh en el ejercicio de sus atribuciones legales.

Para fines de remitir la información que el BCCh requiera a través del SIID, el Participante se obliga a observar los términos y condiciones establecidos en el Capítulo III.D.3 y su Reglamento Operativo, así como la normativa que la modifique o reemplace y las instrucciones que la Comisión para el Mercado Financiero pueda impartir en ejercicio de sus facultades, en su caso, que resulten aplicables al Participante.

Lo anterior, comprende la aceptación expresa del Participante de la facultad del BCCh de resolver, a su juicio exclusivo, cualquier duda que se presente respecto de la aplicación o interpretación de su normativa, atribución cuyo ejercicio no podrá, en ningún caso, entenderse como antecedente o causa constitutiva de daño, perjuicio, detrimento o menoscabo para el mismo. Asimismo, el Participante acepta expresamente y a plenitud cualquier modificación, adición, aclaración y/o sustitución posterior que se realice tanto al citado Capítulo como al Reglamento Operativo, las que serán comunicadas por los medios que el BCCh estime satisfactorios a su juicio exclusivo.

Del mismo modo, el Participante acepta cumplir los requerimientos relacionados a las características y especificaciones técnicas que el BCCh pueda determinar en materia de comunicaciones, registros, reportes y otros aspectos relacionados al SIID, declarando asimismo conocer y aceptar que el BCCh -en su calidad de propietario y administrador de este Sistema- puede modificar dichos requerimientos con la periodicidad y oportunidad que estime conveniente, todo lo cual el Participante se obliga a cumplir. Lo anterior, comprende también la aceptación y debido cumplimiento de los términos y condiciones que el BCCh pueda establecer para el uso del SIID en el portal web de su acceso, incluyendo la estricta observancia de las instrucciones que el Banco pueda impartir con para resguardar la continuidad operacional del Sistema.

Al final de esta comunicación el Participante individualiza ante el BCCh, la o las personas que actuarán como sus apoderados autorizados para representarlo en el envío de la información antedicha al Banco a través del SIID, en adelante los “Administradores de Perfiles”, encontrándose estos además facultados para delegar dicha función en otras personas. El Participante adjunta, como parte de esta comunicación, una declaración jurada ante Notario que acredita que el o los respectivos apoderados designados al efecto, cuentan con poder suficiente para actuar en su nombre y representación en el envío de los reportes que se efectúen al SIID, así como para delegar el respectivo encargo en otros usuarios. Asimismo, se deja constancia que toda revocación o modificación de los referidos “Administradores de Perfiles” previamente designados, será informada mediante carta suscrita por el Participante o su representante legal, junto con acompañar la declaración jurada antedicha respecto de los nuevos Administradores que designe.

En este contexto, el Participante declara conocer y aceptar que toda utilización, acceso y operación del SIID realizada por los “Administradores de Perfiles” acreditados ante el Banco, o por los usuarios que dicho Administrador pueda designar, se entenderá para todos los efectos legales como ejecutada por el Participante. Por lo anterior, el Participante se obliga a adoptar todas las medidas jurídicas, administrativas y de control y gestión de riesgos, que sean necesarias para que el SIID sea utilizado sólo por las personas que ha facultado para ello.



Al respecto, y tratándose del o los “Administradores de Perfiles”, el BCCh hará entrega de claves de acceso al SIID, las que en el caso de otros usuarios designados por estos últimos serán otorgadas directamente por el respectivo “Administrador de Perfiles”. Las claves de acceso referidas, serán secretas, personales e intransferibles, circunstancia respecto de la cual el Participante procurará su debido resguardo. Por ende, el Participante, acepta que será el único y exclusivo responsable por el adecuado uso de las claves asignadas o configuradas y por la información que se ingrese al SIID en su representación.

En consecuencia, el Participante libera de responsabilidad y se obliga a indemnizar al BCCh respecto de cualquier pérdida o perjuicio que pueda sufrir con motivo del uso que haga del SIID, incluyendo reclamaciones interpuestas en contra del BCCh por otros participantes o por terceros.

En caso que la información reportada al SIID sea enviada a través de un Agente Autorizado, conforme lo permite la citada normativa del BCCh, el Participante se obliga a que dicho Agente actúe en su representación y cumpla con lo señalado en la presente Solicitud, así como lo dispuesto en el Capítulo III.D.3 del CNF y su correspondiente Reglamento Operativo, incluyendo las modificaciones que en el futuro el BCCh pueda introducir a esa normativa en el ejercicio de sus atribuciones legales. Según lo indicado, para el caso que el Participante remita información a través de uno o más Agentes Autorizados, deja constancia de su individualización en la presente solicitud.

Conforme a lo expresado, el Participante declara tener conocimiento que la información que proporcione sobre contratos de derivados al Banco Central de Chile (BCCh), en forma electrónica a través del SIID, será entregada bajo juramento, en cuanto a que los datos contenidos en los reportes que remita al BCCh, corresponderán en forma fidedigna y exacta a las operaciones que el Participante informe en cada caso, debiendo precisar además si los antecedentes que conforman el respectivo reporte dicen o no relación con el cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del Compendio de Normas de Cambios Internacionales (CNCI).

Al respecto, tratándose de información cambiaria, el Participante deja constancia expresa que estos antecedentes los proporcionará al Banco Central de Chile para dar cumplimiento a las normas contempladas en los Capítulos citados del CNCI, establecidas por el BCCh conforme a lo dispuesto en el Párrafo Octavo del Título III de su Ley Orgánica Constitucional, las que el Participante declara conocer asumiendo la responsabilidad que se establece en la normativa legal antedicha.

## **DATOS A COMPLETAR**

### **A. Identificación del Participante (Completar según corresponda N° 1 o 2 siguiente)**

#### **1. En caso que el Participante sea persona jurídica:**

Razón Social:  
RUT:  
Domicilio:  
Comuna:  
Ciudad:  
Teléfono (país-ciudad-número):  
Nombre del Gerente General:  
Correo electrónico del Gerente General:  
Nombre del Representante Legal:  
Correo electrónico del Representante Legal:

#### **2. En caso que el Participante sea persona natural:**

Nombre (nombre, apellido paterno, apellido materno):  
N° Cédula de identidad:  
Nacionalidad:  
Domicilio:  
Comuna:  
Ciudad:  
Teléfono (país-ciudad-número):  
Correo electrónico:



**B. Identificación de él o los “Administradores de Perfiles”:**

1. Nombre (nombre, apellido paterno, apellido materno):  
N° Cédula de identidad:  
Correo electrónico:  
Teléfono (país – ciudad - número):  
Cargo de la persona autorizada:  
Unidad o Departamento donde trabaja la persona autorizada:

2. Nombre (nombre, apellido paterno, apellido materno):  
N° Cédula de identidad:  
Correo electrónico:  
Teléfono (país – ciudad - número):  
Cargo de la persona autorizada:  
Unidad o Departamento donde trabaja la persona autorizada:

3. Nombre (nombre, apellido paterno, apellido materno):  
N° Cédula de identidad:  
Correo electrónico:  
Teléfono (país – ciudad - número):  
Cargo de la persona autorizada:  
Unidad o Departamento donde trabaja la persona autorizada:

**C. Identificación del o los Agentes Autorizados para efectuar reportes al SIID en representación del participante:**

1. Nombre o Razón Social:  
RUT:  
Domicilio:  
Comuna:  
Ciudad:  
País:  
Teléfono (país-ciudad-número):  
Nombre del Gerente General:  
Correo electrónico del Gerente General:  
Nombre del Representante Legal:  
Correo electrónico del Representante Legal:

---

Nombre(s) y firma(s) Autorizada(s) del Participante



### DECLARACIÓN JURADA

El /Los suscrito(s) \_\_\_\_\_ declara(n) bajo juramento tener la calidad de representante(s) legal(es) de \_\_\_\_\_ RUT \_\_\_\_\_. En tal calidad declara(n) además, lo siguiente:

1.- Que posee(n) los poderes suficientes para designar a los “Administradores de Perfiles” señalados en esta Solicitud de Acceso, en su calidad de apoderados especialmente autorizados para remitir la información requerida al Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (SIID) del Banco Central de Chile. Del mismo modo, declaran que respecto de él o los Agentes Autorizados, cuentan con facultades suficientes para efectuar su designación en la referida calidad.

2.- Que la o las personas designadas como “Administradores de Perfiles” tienen poderes suficientes para asumir tal representación ante el Banco Central de Chile y que pueden, asimismo, delegarla cuantas veces estimen conveniente en otras personas.

En \_\_\_\_\_ a \_\_\_\_ de \_\_\_\_\_ de \_\_\_\_\_

[Firmó ante mí \_\_\_\_ (Nombre de el o los representantes legales de la empresa) \_\_\_\_\_

/Alternativa: Obtener autorización de la o las firmas en la calidad en que se comparece, por Notario Público, sin necesidad de comparecencia de los firmantes conforme al artículo 401 N° 10 del Código Orgánico de Tribunales.]

### **Instrucciones para completar la presente Solicitud de Acceso:**

1. Si esta Solicitud es presentada por un Participante que corresponda a una persona jurídica, se deberá completar la declaración jurada que se incluye al final de ésta y cuya firma sea autorizada ante o por Notario.  
En cambio, si esta Solicitud es presentada directamente por un Participante que corresponda a una persona natural, la firma de esta solicitud deberá ser autorizada ante Notario o ante el Ministro de Fe que corresponda, debidamente legalizada o apostillada, según corresponda y deberá acompañar fotocopia de ambos lados de la cédula de identidad del Participante, también autorizada ante Notario.
2. En la Sección A de “Datos a Completar” de esta Solicitud, en la cual se contiene la identificación del Participante, sólo se debe completar su numeral 1, en caso de tratarse de una persona jurídica, o su numeral 2, en caso de corresponder a una persona natural, pero no ambas conjuntamente.
3. En caso de requerir identificar más “Administradores de Perfiles” que los incluidos en esta Solicitud, se deberá ajustar el presente formato en esa Sección.
4. En caso de existir enmendaduras, la solicitud será rechazada.
5. Esta solicitud debe presentarse en la Gerencia de División Estadísticas del BCCh, ubicada en Morandé 115, de lunes a viernes, entre las 09:00 y las 16:00 horas, en días hábiles bancarios.



## ANEXO N° 2

### ÍNDICE DE TABLAS

|  |
|--|
| Tabla 1: Naturaleza de la Información                              |
| Tabla 2: Eventos de Reporte  |
| Tabla 3: Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente |
| Tabla 4: Instrumentos  |
| Tabla 5: Clase de Opción   |
| Tabla 6: Tipo de Posición  |
| Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente                         |
| Tabla 8: Modalidad de Liquidación                                  |
| Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés                                   |
| Tabla 10: Objetivo de la Operación                                 |
| Tabla 11: Convenio Marco   |
| Tabla 12: Garantías  |
| Tabla 13: Cláusula de Recouponsing                                 |
| Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado                           |
| Tabla 15: Compresión de Cartera                                    |
| Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía                              |
| Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado                                   |
| Tabla 18: Método de Valorización                                   |





## TABLAS

### REGLAMENTO OPERATIVO DEL SISTEMA INTEGRADO DE INFORMACIÓN SOBRE TRANSACCIONES DE DERIVADOS (RO-SIID)

#### Índice

|   |   |
|---|---|
| Tabla 1: Naturaleza de la Información .....                             | 2 |
| Tabla 2: Eventos de Reporte .....                                       | 2 |
| Tabla 3: Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente..... | 2 |
| Tabla 4: Instrumentos .....   | 3 |
| Tabla 5: Clase de Opción.....   | 3 |
| Tabla 6: Tipo de Posición.....  | 3 |
| Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente.....                         | 3 |
| Tabla 8: Modalidad de Liquidación .....                                 | 4 |
| Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés .....                                  | 4 |
| Tabla 10: Objetivo de la Operación .....                                | 6 |
| Tabla 11: Convenio Marco .....  | 6 |
| Tabla 12: Garantías .....   | 6 |
| Tabla 13: Cláusula de <i>Recouponing</i> .....                          | 7 |
| Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado .....                          | 7 |
| Tabla 15: Compresión de Cartera.....                                    | 7 |
| Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía.....                              | 7 |
| Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado .....                                  | 8 |
| Tabla 18: Método de Valorización .....                                  | 8 |



Tabla 1: Naturaleza de la Información

| Descripción  |
|--|
| El Evento de Reporte se comunica en cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI, sobre operaciones con instrumentos derivados.                       |
| El Evento de Reporte NO se comunica en cumplimiento de la normativa cambiaria antedicha, sino que se ajusta a los demás requerimientos generales previstos en el Capítulo III.D.3 del CNF. |

Tabla 2: Eventos de Reporte

| Numeral | Descripción                                    |
|---------|--|
| 2.1.1   | Nuevo contrato                                 |
| 2.1.2   | Adquisición por cesión                         |
| 2.2.1   | Modificación por <i>recouping</i>              |
| 2.2.2   | Modificación de contraparte por cesión         |
| 2.2.3   | Otras modificaciones                           |
| 2.2.4   | Modificación por corrección de reporte         |
| 2.3.1   | Término por caducidad, anticipo o resciliación |
| 2.3.2   | Término por cesión                             |
| 2.3.3   | Término por anulación                          |
| 2.3.4   | Mensual operaciones vencidas                   |
| 2.4.1   | Mensual operaciones vigentes                   |

Tabla 3: Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente

| Descripción   |
|---|
| <i>International Securities Identification Number (ISIN)</i>  |
| <i>Nemotécnico</i>  |
| <i>Alternative Instrument Indicator (AII)</i>                 |
| <i>Committee on Uniform Securities Identification (CUSIP)</i> |
| <i>Stock Exchange Daily Official List (SEDOL)</i>             |
| Otro  |



Tabla 4: Instrumentos

| Descripción                | Sistema al que aplica   |
|----------------------------|---|
| <i>Cross Currency Swap</i> | I (Monedas)   |
| <i>Forward</i> Observado   | I (Monedas)   |
| <i>FX Swap</i>             | I (Monedas)   |
| Futuro                     | I, II y III (Monedas, Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente) |
| <i>Forward</i>             | I, II y III (Monedas, Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente) |
| <i>Swaption</i>            | I y II (Monedas y Tasas de Interés, respectivamente)                  |
| Opción <i>Call</i>         | I (Monedas)   |
| Opción <i>Put</i>          | I (Monedas)   |
| Opción <i>Cap</i>          | II y III (Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente)             |
| Opción <i>Floor</i>        | II y III (Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente)             |
| <i>Interest Rate Swap</i>  | II (Tasas de Interés)   |
| Otros                      | I, II y III (Monedas, Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente) |

Tabla 5: Clase de Opción

| Descripción |
|-------------|
| Americana   |
| Bermuda     |
| Europea     |
| Asiática    |
| Otras       |
| No Aplica   |

Tabla 6: Tipo de Posición

| Descripción |
|-------------|
| Compradora  |
| Vendedora   |

Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente

| Descripción                | Sistema al que aplica |
|----------------------------|-----------------------|
| <i>Cross Currency Swap</i> | I (Monedas)           |
| <i>Interest Rate Swap</i>  | II (Tasas de Interés) |



Tabla 8: Modalidad de Liquidación

|                |
|----------------|
| Descripción    |
| Compensación   |
| Entrega Física |

Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés

| Descripción  |
|--|
| Tasa fija  |
| TAB UF a 90 días   |
| TAB UF a 180 días  |
| TAB UF a 360 días  |
| TAB nominal a 30 días  |
| TAB nominal a 90 días  |
| TAB nominal a 180 días   |
| TAB nominal a 360 días   |
| TADO a 30 días   |
| TADO a 60 días   |
| TADO a 90 días   |
| TADO a 180 días  |
| TADO a 360 días  |
| Tasa nominal anualizada ICP  |
| Tasa real anualizada ICP   |
| <i>Prime Rate</i>  |
| LIBOR en Dólares de los EE.UU <i>overnight</i> (ICE)                                 |
| LIBOR en Dólares de los EE.UU a 30 días (ICE)  |
| LIBOR en Dólares de los EE.UU a 7 días (ICE)   |
| LIBOR en Dólares de los EE.UU a 60 días (ICE)  |
| LIBOR en Dólares de los EE.UU a 90 días (ICE)  |
| LIBOR en Dólares de los EE.UU a 180 días (ICE)                                       |
| LIBOR en Dólares de los EE.UU a 360 días (ICE)                                       |
| SOFR ( <i>Secured Overnight Financing Rate</i> ) de la Reserva Federal de Nueva York |
| <i>US Federal Funds Effective Rate</i>   |
| <i>United States Overnight Bank Funding Rate</i>                                     |
| Tasa de la curva de rendimiento del Tesoro de los EE.UU a 10 años                    |
| Tasa de la curva de rendimiento del Tesoro de los EE.UU a 3 años                     |
| LIBOR en Euros <i>overnight</i> (ICE)  |
| LIBOR en Euros a 7 días (ICE)  |
| LIBOR en Euros a 30 días (ICE)   |



| Descripción  |
|--|
| LIBOR en Euros a 60 días (ICE)                             |
| LIBOR en Euros a 90 días (ICE)                             |
| LIBOR en Euros a 180 días (ICE)                            |
| LIBOR en Euros a 360 días (ICE)                            |
| ESTER (Euro Short-Term Rate)                               |
| Euribor a 1 semana   |
| Euribor a 2 semanas  |
| Euribor a 30 días  |
| Euribor a 60 días  |
| Euribor a 90 días  |
| Euribor a 180 días   |
| Euribor a 270 días   |
| Euribor a 12 meses   |
| EONIA ( <i>Euro Overnight Index Average</i> )              |
| LIBOR en Libras esterlinas overnight (ICE)                 |
| LIBOR en Libras esterlinas a 7 días (ICE)                  |
| LIBOR en Libras esterlinas a 30 días (ICE)                 |
| LIBOR en Libras esterlinas a 60 días (ICE)                 |
| LIBOR en Libras esterlinas a 90 días (ICE)                 |
| LIBOR en Libras esterlinas a 180 días (ICE)                |
| LIBOR en Libras esterlinas a 360 días (ICE)                |
| SONIA ( <i>Sterling Overnight Interbank Average Rate</i> ) |
| LIBOR en Francos suizos <i>spot next day</i> (ICE )        |
| LIBOR en Francos suizos a 7 días (ICE)                     |
| LIBOR en Francos suizos a 30 días (ICE)                    |
| LIBOR en Francos suizos a 60 días (ICE)                    |
| LIBOR en Francos suizos a 90 días (ICE)                    |
| LIBOR en Francos suizos a 180 días (ICE)                   |
| LIBOR en Francos suizos a 360 días (ICE)                   |
| Libor en Yenes japoneses <i>spot next day</i> (ICE)        |
| Libor en Yenes japoneses a 7 días (ICE)                    |
| Libor en Yenes japoneses a 30 días (ICE)                   |
| Libor en Yenes japoneses a 60 días (ICE)                   |
| Libor en Yenes japoneses a 90 días (ICE)                   |
| Libor en Yenes japoneses a 180 días (ICE)                  |
| Libor en Yenes japoneses a 360 días (ICE)                  |
| Otra tasa variable   |



Tabla 10: Objetivo de la Operación

| Descripción  |
|--|
| Negociación  |
| Cobertura de Riesgo de Posiciones del Balance          |
| Cobertura Contable Valor Razonable                     |
| Cobertura Contable Flujo de Caja                       |
| Cobertura Contable de Inversiones Netas en el Exterior |

NOTA: La clasificación de objetivos de la operación de derivados descrita en la tabla anterior, se corresponde con la Norma Internacional de Información Financiera (IFRS). Las categorías de “Negociación” y “Cobertura de Riesgo de Posiciones de Balance” corresponderán a instrumentos financieros derivados, clasificados contablemente para negociación. La categoría “Cobertura de Riesgo de Posiciones de Balance” podrá ser utilizada por bancos y sus filiales que cuenten con la separación de sus mesas de dinero entre la actividad de negociación (trading) y la gestión de activos y pasivos (ALM) y que efectúen coberturas de riesgo de las posiciones del balance que no sean designadas como coberturas contables. Aquellos Participantes que no cuenten con lo anteriormente señalado, deberán informar la totalidad de los instrumentos en la categoría de “Negociación”.

Tabla 11: Convenio Marco

| Descripción   |
|---|
| Condiciones Generales para Contratos de Derivados en el Mercado Local, aprobadas por la Asociación de Bancos e Instituciones Financieras y reconocidas por el Banco Central de Chile. |
| <i>International Swaps and Derivatives Association.</i>   |
| Otros convenios no contemplados previamente.  |
| No está sujeto a convenio marco.  |

Tabla 12: Garantías

| Descripción  |
|--|
| Completamente caucionado o garantizado: Ambos constituyen Margen Inicial y Margen de Variación               |
| Parcialmente caucionado o garantizado: Solo el Margen de Variación será constituido por alguna de las partes |
| Solo la Contraparte 1 constituye alguna forma de garantía (Margen Inicial y/o Margen de Variación)           |
| Solo la Contraparte 2 constituye alguna forma de garantía (Margen Inicial y/o Margen de Variación)           |
| Ninguna contraparte constituye garantías   |
| Contraparte Central  |



Tabla 13: Cláusula de *Recouping*

| Descripción                      |
|----------------------------------|
| Con cláusula de <i>Recouping</i> |
| Sin cláusula de <i>Recouping</i> |

Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado

| Descripción                                  |
|--|
| A favor de la Contraparte 1, con liquidación |
| A favor de la Contraparte 1, sin liquidación |
| A favor de la Contraparte 2, con liquidación |
| A favor de la Contraparte 2, sin liquidación |
| Opcional ambas partes, con liquidación       |
| Opcional ambas partes, sin liquidación       |
| Sin cláusula de término anticipado           |

Tabla 15: Compresión de Cartera

| Descripción   |
|---|
| Contrato es resultado de una compresión de cartera    |
| Contrato no es resultado de una compresión de cartera |

Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía

| Descripción  |
|--|
| Efectivo   |
| Depósitos  |
| Bonos Corporativos                                     |
| Bonos del Banco Central de Chile                       |
| Bonos de la Tesorería General de la República de Chile |
| Bonos Soberanos Extranjeros                            |
| Bonos Corporativos Extranjeros                         |
| Acciones   |
| Bienes Inmuebles                                       |
| Otras garantías  |



Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado

| Descripción   |
|---|
| Pago o intercambio de intereses (aplica para entrega física y compensación)   |
| Pago o intercambio de principales (aplica para entrega física y compensación) |
| Prima o pago realizado al inicio del contrato                                 |
| Pago originado por el cierre anticipado del contrato                          |
| Pago originado por recouping  |
| Otros   |

Tabla 18: Método de Valorización

| Descripción  |
|--|
| Valor razonable a precios de mercado ( <i>mark-to-market</i> ) |
| Valor razonable utilizando modelos ( <i>mark-to-model</i> )    |
| Valor razonable calculado por Contraparte Central              |
| Otro   |