

BANCO CENTRAL DE CHILE
Gerencia División Internacional

SANTIAGO, 19 de mayo de 2000

CIRCULAR N° 711

MAT.: Modifica Anexos N° 1 y N° 4 del Capítulo VI del Título I del Compendio de Normas de Cambios Internacionales.

Señor
Gerente:

De nuestra consideración:

Conforme con lo establecido en el Acuerdo 839E-01-000511 del Consejo del Banco Central de Chile, se amplió el universo de operaciones con instrumentos derivados que pueden pactar las empresas bancarias, estableciéndose además la obligación de informar la realización de esas operaciones por parte de terceros no bancos.

En atención de lo anterior y conforme lo dispone la letra D del Capítulo VI, Título I del CNCI, quienes hayan realizado operaciones de derivados con contrapartes domiciliadas en el exterior al amparo de dicho Capítulo deberán entregar a la Gerencia de Operaciones Financieras Internacionales del Banco Central de Chile la información sobre sus transacciones, utilizando para el efecto los Anexos del mencionado Capítulo.

Al respecto, informamos a usted que como consecuencia del Acuerdo precitado, se ha decidido modificar los Anexos N°s. 1 y 4 señalados en materia, con el objeto de simplificar y disminuir el número de ejemplares que se deben enviar a este Banco Central y permitir, simultáneamente, una captura más eficiente de información.

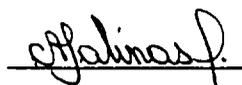
La principal modificación al Anexo N°1 consiste en que, en el futuro, el usuario deberá presentar un solo formulario por mes, dentro de los plazos establecidos en el citado Capítulo VI, con los movimientos mensuales y saldos finales de sus operaciones con instrumentos derivados pactados con personas domiciliadas en el exterior sobre cualquier subyacente.

Las principales modificaciones al Anexo N° 4 consisten en que, en adelante, deberá ser utilizado para informar los derivados sobre monedas, entre las que se incluyen la moneda corriente nacional y la Unidad de Fomento, y todo tipo de instrumentos derivados, no solamente los forwards y swaps. En cuanto a la periodicidad de su envío, los usuarios distintos de Empresas Bancarias y Entidades del MCF deberán informar mensualmente, dentro del plazo establecido en la norma, el detalle de todas sus operaciones sobre monedas y Unidad de Fomento, en tanto las Empresas Bancarias y Entidades del MCF, deberán enviar la información de dichas operaciones el día hábil bancario siguiente al de la fecha de suscripción.

Finalmente, para efectos de facilitar que las citadas disposiciones estén en conocimiento de todos los agentes involucrados, se solicita a las Empresas Bancarias y Entidades del MCF que comuniquen a sus empresas relacionadas y clientes que pactan derivados sobre monedas y Unidad de Fomento con contrapartes domiciliadas en el exterior, que a partir del 12 de mayo del año en curso, estas operaciones han quedado reguladas, por lo que deben ser informadas al Banco Central en los plazos establecidos en los párrafos anteriores y los eventuales flujos de divisas deben ser canalizados a través del MCF e informados mediante el Anexo N° 2, de acuerdo a lo señalado en el citado Capítulo VI.

Junto a la presente Circular, se adjuntan los Anexos N° 1 y N° 4, modificados con sus Instrucciones de Uso correspondientes, los que reemplazarán a los actuales.

Atentamente,



CRISTIAN SALINAS CERDA

GERENTE DIVISION INTERNACIONAL (S)

Incl: lo citado

Distribución

-Destinatarios

-Depto. Ops. de Deuda (2)

-Archivo

g:dctos/c/Circular17052000.doc

ANEXO N° 1 DEL CAPITULO VI DEL TITULO I DEL CNCI
MOVIMIENTO MENSUAL Y SALDOS FINALES DE OPERACIONES
CON INSTRUMENTOS DERIVADOS REALIZADAS CON PERSONAS DOMICILIADAS EN EL EXTERIOR

Señores
 Banco Central de Chile
 Gerencia División Internacional
 Gerencia Operaciones Financieras Internacionales
 Departamento Operaciones de Deuda
 Presente

Mes - Año que se informa ____/____

De nuestra consideración :

Declaramos haber efectuado las operaciones que a continuación se indican, de acuerdo a las normas establecidas en el Capítulo VI del Título I del Compendio de Normas de Cambios Internacionales:

1.- DATOS DEL USUARIO

Nombre:	<input type="text"/>	Rut:	<input type="text"/>
Domicilio:	<input type="text"/>	Teléfono:	<input type="text"/>
Código Comercio:	<input type="text"/>		

2.- DATOS DE LAS OPERACIONES
MOVIMIENTOS MENSUALES Y SALDOS FINALES

TIPO DE SUBYACENTE	INSTRUMENTO	CIFRAS EN MILES DE / VOLUMEN EN	TRANSACCION	SALDO INICIAL	MONTO / VOLUMEN SUSCRITO	MONTO / VOLUMEN VENCIDO	SALDO FINAL
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	COMPRAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
			VENTAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	COMPRAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
			VENTAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	COMPRAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
			VENTAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	COMPRAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
			VENTAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	COMPRAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
			VENTAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	COMPRAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
			VENTAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	COMPRAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
			VENTAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	COMPRAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
			VENTAS	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Fecha de envío al BCCH (dd / mm / aa) ____ / ____ / ____
--

Adjuntar, según corresponda:
 Operaciones en Bolsa: Estado de Cuenta Mensual del Corredor.
 Operaciones Fuera de Bolsa: Confirmaciones de la Contraparte.

 Nombre y Firma del USUARIO

ANEXO N° 1 DEL CAPITULO VI DEL TITULO I DEL CNCI

INSTRUCCIONES DE USO DEL FORMULARIO

I. INSTRUCCIONES GENERALES:

Las instrucciones de llenado de este Anexo deben ser respetadas en su integridad para que una vez enviado al Banco Central de Chile, permitan el correcto procesamiento de la información contenida en él.

En este formulario se presentan los movimientos mensuales y saldos finales de futuros, forwards, swaps, opciones, derivados de créditos y combinaciones de éstos, sobre: monedas extranjeras; moneda corriente nacional; Unidad de Fomento; tasas de interés extranjeras; instrumentos de renta fija; colocaciones comerciales; productos; instrumentos de renta variable e índices accionarios que se transen en Bolsas del Exterior, convenidos con una persona domiciliada en el exterior, tanto en Bolsa como fuera de ella. El plazo establecido para el envío de este Anexo es dentro de los diez primeros días hábiles bancarios del mes siguiente a aquel en que fue suscrita la operación.

Se entenderá por saldo final el total de contratos, ya sea de compras o de ventas, que al cierre del mes que se está informando no han vencido (utilizando como referencia la fecha de maduración del contrato).

El USUARIO deberá presentar un solo formulario por mes, en el cual deberá detallar cada uno de los instrumentos derivados con que este operando, en forma separada por subyacente sobre el que tenga operaciones, ya sea este moneda extranjera, moneda corriente nacional, Unidad de Fomento, tasa de interés extranjera, instrumento de renta fija, colocación comercial, producto, instrumento de renta variable e índice accionario.

Para los derivados sobre monedas y Unidad de Fomento, para cada uno de los instrumentos, se deberán informar los valores consolidados de las operaciones en dólares. Esto significa que si el USUARIO tiene forwards de compra de yenes y forwards de compra de Marcos Alemanes, deberá informar forwards de venta de dólares por la cantidad consolidada de estas dos monedas, en su equivalente en dólares, considerando para estos efectos el precio forward pactado en cada caso.

II. INSTRUCCIONES ESPECIFICAS:

Mes/Año que se informa Señalar el mes y año al que corresponden las operaciones informadas.

1.- DATOS DEL USUARIO:

Nombre	Indicar la razón social de la empresa o entidad bancaria que está informando.
Rut	Señalar el Rol Unico Tributario actualizado del USUARIO que está informando.
Domicilio	Indicar el domicilio actualizado del USUARIO que está informando.
Teléfono	Indicar el número telefónico de la persona responsable ante el Banco Central de Chile de los Anexos enviados.
Código Comercio	El Código de Comercio del Informante debe corresponder al referido en la Tabla N° 5, Anexo N° 14 del Capítulo XIV, Título I del CNCI., el cual está disponible en la página web “ www.bcentral.cl ”.

2.- DATOS DE LAS OPERACIONES, MOVIMIENTOS MENSUALES Y SALDOS FINALES

Para la presentación de las operaciones utilizar el formato 999.999.999,99.

Tipo de Subyacente	Especificar en el recuadro correspondiente, el tipo de moneda, tasa de interés extranjera, instrumento de renta fija, colocación comercial, producto, instrumento de renta variable e índice accionario con que se esté operando.
Instrumento	Especificar en este recuadro el tipo de instrumento derivado con que el USUARIO está operando, por cada subyacente. (Futuros, forwards, swaps, opciones, derivados de crédito o combinaciones de estos).
Cifras en Miles de / Volumen en	Señalar en el recuadro que corresponda, la unidad en la que están expresadas las operaciones informadas. Por ejemplo, si se tratara de Futuros de Oro, se refiere a volumen y debería aparecer en el recuadro la palabra "Onzas". Si se tratara de Futuros en Marcos Alemanes, se refiere a montos en miles y debería aparecer en el recuadro la palabra "Marcos Alemanes".
Saldo Inicial	Señalar en los recuadros correspondientes, tanto las compras como las ventas del "Saldo Final" del mes anterior al informado. Las operaciones deberán ser presentadas como compras o ventas, dependiendo de la transacción efectuada por el USUARIO. Por ejemplo, si se trata de una compra de opciones PUT de cobre, el volumen se presentará en el recuadro compras y si se trata de una venta (emisión) de opciones PUT de cobre, el volumen se presentará en el recuadro ventas. En caso que el subyacente sea tasa de interés extranjera y el USUARIO esté pagando tasa fija, deberá colocar en el recuadro "Ventas" las cifras correspondientes a los montos nominales involucrados en los movimientos que se realicen. Si el USUARIO está pagando tasa flotante, los datos respectivos deberán ser presentados en el recuadro "Compras". Si se trata de una operación "COLLAR" el monto notional suscrito deberá ser presentado en el recuadro "Ventas".
Monto/Volumen Suscrito	Señalar en los recuadros correspondientes, el total de compras y/o ventas suscritas en el mes que se informa.

Monto/Volumen Vencido	Señalar en los cuadros correspondientes, el total de compras y/o ventas vencidas en el mes que se informa (tomando como referencia la fecha de maduración).
Saldo Final	Para el caso de las Compras, se obtiene de la suma del "Saldo Inicial" (Compras) más el "Monto/Volumen Suscrito" (Compras) menos el "Monto/Volumen Vencido" (Compras). En caso de las Ventas se utiliza el mismo criterio, considerando el movimiento de las Ventas.
Fecha de envío al Banco Central de Chile	Indicar el día, mes y año en que se envía el presente Anexo al Banco Central de Chile. El USUARIO debe considerar que para dicho envío existe un plazo establecido en el presente Capítulo.

ANEXO N° 4 DEL CAPITULO VI DEL TITULO I DEL CNCI.

INSTRUCCIONES DE USO DEL FORMULARIO

I. INSTRUCCIONES GENERALES:

- Las Instrucciones de llenado de este Anexo deben ser respetadas en su integridad, para que una vez enviado al Banco Central, permitan el correcto procesamiento de la información contenida en él.
- El USUARIO deberá identificar con una "X" en el recuadro pertinente, si el anexo corresponde a un "Informe de Operaciones" o a un "Informe de Modificaciones".
- Si se trata de un "Informe de Operaciones", el Formulario está diseñado para que se presenten las operaciones suscritas identificando cada operación en una sola línea. Todas las operaciones deben ser ordenadas por instrumento y por N° de contrato, sin dejar líneas en blanco. Las operaciones que el USUARIO no hubiese podido informar en su oportunidad; también deberán ser incluidas en este Informe, pero utilizando un Formulario aparte, consignando la fecha de suscripción correspondiente.
- El "Informe de Modificaciones", sólo se emplea cuando se comuniquen modificaciones a operaciones ya informadas. Para este efecto, sólo se llena(n) la (las) columnas con el (los) datos del contrato que se está(n) modificando, debiendo indicar necesariamente para cada operación en que se esté informando una modificación, el N° de contrato, la fecha de suscripción, y el nombre de la contraparte, del respectivo contrato.

II. INSTRUCCIONES DE LOS CAMPOS RELEVANTES:

<u>N° Campo</u>	<u>Datos contenidos</u>
N° 1. Nombre Informante	Indicar la razón social de la empresa, Entidad Bancaria o Entidad MCF. que está informando.
N° 2. Código Institución Financiera	El código de la Institución Financiera debe corresponder al referido en el Título V del CNCI., por lo que sólo tiene que ser completado cuando el Informante sea una Empresa Bancaria o una Entidad MCF.
N° 3. Rut	Debe corresponder al Rol Unico Tributario actualizado del Informante.
N° 4. Código Comercio Informante	El Código de Comercio Informante debe corresponder al referido en la Tabla N° 5, Anexo N° 14 del Capítulo XIV, Título I del CNCI. Este campo se completará en todos los casos, independientemente si el Informante es una Empresa Bancaria, una Entidad MCF. u otra empresa.
N° 5. Número páginas Informadas	Utilizar formato N° <u>0 i</u> de <u>0 n</u> .
N° 6. Información de operaciones suscritas el....	Los USUARIOS no bancos deben usar el formato mm/aa, mientras que los que sean Empresas Bancarias o Entidades MCF. deben usar el formato dd/mm/aa. Este dato se omite en el caso del Informe de Modificaciones
N° 7. Contraparte extranjera	Indicar el nombre o razón social de la Contraparte informada.
N° 8. Código País	El Código País debe corresponder al referido en el Título V del CNCI., para el país de la Contraparte extranjera.
N° 9. País	Indicar el país de la Contraparte extranjera.

N° 10. N° de Contrato	Asignar un correlativo (solamente numérico), único por cada contrato suscrito, para la fecha indicada en el N°6. Ello implica que no podrá duplicarse el número de contrato para una misma fecha de suscripción. No obstante lo anterior, existe una excepción en caso del instrumento swap, dado que en este tipo de contrato se suscribe la operación en una fecha para distintas fechas de maduración, las cuales deben ser informadas en distintas líneas del formulario, con un mismo número de contrato y una misma fecha de suscripción.
N° 11. Fecha de Suscripción	Señalar la fecha de cierre del contrato, en formato dd/mm/aa.
N° 12. Fecha de Vencimiento	Debe señalar la fecha de término del contrato, en formato dd/mm/aa.
N° 13. Número de días	Indicar la diferencia resultante de: (Fecha de Vencimiento - Fecha de Suscripción)
N° 14. Modalidad de Pago	Indicar modalidad de pago estipulada en el contrato, señalando: C = Si es compensación, o, E = Si es entrega física.
N° 15. Código Instrumento	Se debe indicar el código de instrumento utilizado, de acuerdo a lo siguiente: 01: Forward; 02: Futuro; 03: Opción Call; 04: Opción Put; 05: Swap y 06: combinación de los anteriores.
N° 16. Instrumento	Indicar el tipo de Instrumento utilizado, según corresponda.

NOTA 1:

– Se entenderá por COMPRAS, el tipo de monedas y montos recibidos, y por VENTAS, el tipo de monedas y montos entregados.

N° 17. Código Moneda Recibida	Indicar el código establecido en el Título V del CNCI., para las monedas extranjeras. En el caso del peso chileno usar el código 999 y en el caso de la Unidad de Fomento usar 998.
N° 18. Moneda Recibida	Indicar la denominación de la moneda recibida, pudiendo usarse el nombre completo, o bien, las abreviaturas convencionales de las operaciones de comercio exterior y cambios internacionales, tales como: \$, UF, DM, £, US\$, ¥, etc.
N° 19. Monto Recibido	Indicar el monto correspondiente a la moneda recibida, usando los siguientes formatos: 999.999.999,99 para las monedas extranjeras, 999.999.999,9999 para la Unidad de Fomento, y, 999.999.999.999 para la moneda nacional (pesos).
N° 20. Código Moneda Entregada	Indicar el código establecido en el Título V del CNCI., para las monedas extranjeras. En el caso del peso chileno usar el código 999 y en el caso de la Unidad de Fomento usar 998.
N° 21. Moneda Entregada	Indicar la denominación de la moneda entregada, pudiendo usarse el nombre completo, o bien, las abreviaturas convencionales de las operaciones de comercio exterior y cambios internacionales, tales como: \$, UF, DM, £, US\$, ¥, etc.
N° 22. Monto Entregado	Indicar el monto correspondiente a la moneda entregada, usando los siguientes formatos: 999.999.999,99 para las monedas extranjeras, 999.999.999,9999 para la Unidad de Fomento, y, 999.999.999.999 para la moneda nacional (pesos).

NOTA 2:

- En los campos “Código Moneda Recibida” (o Entregada), “Moneda Recibida” (o Entregada) y “Monto Recibido” (o Entregado), para el caso del instrumento swap, se deberán informar los montos a intercambiar en cada período definido según contrato, en líneas diferentes para cada fecha de vencimiento, con una misma fecha de suscripción (trade date) y un mismo número de contrato.
- Para el instrumento opción se deberá informar cada operación en una línea diferente, utilizando los campos referentes a COMPRAS para las compras de opciones call o emisión de opciones put, dejando en blanco aquellos campos referentes a VENTAS. A la inversa, cuando se compren opciones put o emitan opciones call, se deben utilizar solamente los campos referentes a VENTAS, dejando en blanco aquellos campos referentes a COMPRAS. Los demás campos no mencionados se deben llenar en todos los casos.

- N° 23. Prima Total (US\$) Este campo se debe completar sólo en caso del instrumento opción, señalando el valor total pagado (con signo negativo) o recibido (con signo positivo), al comprar o emitir una opción, respectivamente. Se deberá señalar la prima total pagada o recibida por cada opción.
- N° 24. Precio Forward - Futuro /
Precio Strike En caso de los Forwards, Futuros y Swaps se debe señalar el precio o paridad que determina el valor de intercambio de las monedas involucradas en el contrato, al plazo pactado en la operación. En caso de las opciones se debe presentar el Precio Strike. Usar el formato 99.999,99.
Para el caso de las operaciones Dólar – Unidad de Fomento, se expresa como precio forward la tasa de interés implícita en el contrato, al plazo pactado en la operación.
Usar el formato UF +/- 99,99%.
- N° 25. Precio Spot Sólo en el caso de las operaciones Dólar - Unidad de Fomento o Dólar-Peso, indicar el valor del tipo de cambio spot en pesos considerado en la determinación del precio forward.
Usar el formato 99.999,99.
- N° 26 y
N° 27. Totales para validación
computacional Consignar la suma algebraica de los montos recibidos y entregados respectivamente, sólo en la última página de cada informe, sin considerar que dichos montos pueden corresponder a diferentes monedas.
- N° 28. Datos apoderados de la
Institución Informante La institución Informante debe consignar el nombre, cargo y firma del apoderado(s) responsable(s) de la operación ante el Banco Central.
- N° 29. Teléfono(s) Apoderado (s) Consignar el teléfono directo del (los) apoderado(s) responsable(s) de la operación, ante el Banco Central.