

Santiago, 8 de agosto de 2001

CIRCULAR N° 755

Modifica Especificaciones Técnicas de archivo de Derivados sobre monedas, enviado vía SINACOFI, Capítulos VI y VII del Manual de Procedimientos y Formularios de Información del Compendio de Normas de Cambios Internacionales.

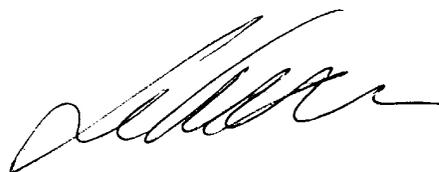
Señor Gerente:

Como es de su conocimiento, el Consejo del Banco Central de Chile, mediante Acuerdo N° 903E-01-010416, aprobó el nuevo Compendio de Normas de Cambios Internacionales y su Manual de Procedimientos y Formularios de Información. Como consecuencia de las modificaciones contenidas en el citado Acuerdo, me permito comunicar a usted que, a partir del 20 de Agosto del presente año, se exigirá que junto con la información contenida en el Anexo N° 1 del Capítulo VII del Manual antes mencionado, que actualmente se envía en un archivo computacional a través de SINACOFI, se incluya también la información contenida en el Anexo N° 2, Capítulo VI del mismo Manual, referida a las operaciones con instrumentos derivados sobre monedas con contrapartes extranjeras, que actualmente se reciben ya sea vía mail, o por entrega en papel.

Para estos efectos, se solicita tener en cuenta lo establecido en el Instructivo de Especificaciones Técnicas del archivo computacional, que se adjunta, el que incorpora en lo que a "Registro de contrato" se refiere, la modificación que ha sido necesario realizar.

Dicho envío computacional debe realizarse diariamente, aún cuando no existan operaciones que informar, en cuyo caso los campos alfanuméricos deberán ser enviados en blanco y los numéricos en cero. La hora tope para enviar la información se mantendrá en las 10:00 AM del día hábil bancario siguiente al de la suscripción de los contratos.

Saluda atentamente a usted,



SERGIO LEHMANN BERESI
Gerente de Análisis y Ops. Internacionales
Gerencia de División Internacional

Incl.: Especificaciones Técnicas

AL SEÑOR
GERENTE DEL BANCO
PRESENTE

INSTRUCTIVO ESPECIFICACIONES TECNICAS

ANTECEDENTES:

El objetivo de este documento consiste en explicitar el nuevo esquema de registro del archivo SINACOFI de contratos forwards, con el fin de incluir operaciones con contraparte extranjera, que actualmente son enviadas por otras vías.

Actualmente, la información de las operaciones con contrapartes extranjeras son recibidas por el Banco Central vía correo electrónico o por mano, por lo que se pretende incorporarlas al envío normal de SINACOFI de las operaciones forwards. Con lo anterior, se centralizará en un solo envío las operaciones forward, tanto en el mercado local como en el extranjero.

Sobre esta base y analizado el esquema de registro actual, se requiere agregar un campo al "Registro de contrato" con el valor de la "Prima Total", para el caso de las opciones realizadas con contrapartes extranjeras.

Además, considerando que actualmente para informar las operaciones con contraparte nacional se indica su nombre y R.U.T.; se debe tener presente que al tratarse de una contraparte extranjera, que carece de R.U.T., se deberá informar en el campo "R.U.T. o código identificador contraparte" del archivo SINACOFI, el "Código Identificador" asignado a la contraparte extranjera respectiva, según lo indicado en la "Tabla de "Códigos Identificadores" de Contrapartes Extranjeras, para Operaciones de Derivados sobre Monedas", contenida en las siguientes direcciones de Internet, disponibles en los formatos que se indican:

1. Documento PDF:

http://www.bcentral.cl/_files/contrapartes/codconex.pdf

2. Documento Word (RTF):

http://www.bcentral.cl/_files/contrapartes/codconex.rtf

3. Documento Excel:

http://www.bcentral.cl/_files/contrapartes/codconex.xls

En caso que la contraparte extranjera no exista en la Tabla citada, como puede ocurrir cuando la contraparte opere en Chile por primera vez, el procedimiento a seguir consistirá en solicitar telefónicamente al Departamento de Operaciones Financieras Internacionales (Sr. Alejandro Nuñez, teléfono 670-2631) la asignación de un "Código Identificador" a utilizar para esa contraparte.

Cabe señalar que la Tabla antes mencionada es de carácter dinámico y podría sufrir modificaciones con el tiempo.

En consecuencia, el archivo de contrato forward que se debe utilizar de ahora en adelante, es el que se detalla a continuación:

1. ARCHIVO DE CARATULA DE CONTRATO FORWARD

Descripción del Registro

Largo registro: 38

CAMPO	Posc.	Largo	PIC
número de registros	1	8	9(8)
suma monto recibido	9	15	9(15)
suma monto entregado	24	15	9(15)

2. ARCHIVO DE CONTRATO FORWARD

El archivo debe contener tres tipos de registros. Un primer registro de control inicial, a continuación los registros con los contratos de forward, y el último registro debe ser el registro de control final.

2.1 Registro de control inicio

Largo registro : 151

CAMPO	Posc.	Largo	PIC
flag de control	1	10	X(10) (*)
rut del informante	11	9	9(9)
dv rut del informante	20	1	X(1)
número de registros de contratos	21	4	9(4)
suma monto recibido	25	21	9(17)v9(4)
suma monto entregado	46	21	9(17)v9(4)
Glosa del Archivo	67	30	X(30) (**)
Fecha	97	8	AAAAMMDD
Código Super de origen	105	3	999
Filler	108	44	X(44)

(*) Rellenar flag de control con "IIIIIIIIII"

(**) Debe decir FWD – CONTRATO FORWARD

2.2 Registro de contrato

Largo registro : **170**

CAMPO	Posc.	Largo	PIC
rut o código identificador contraparte	1	9	9(9)
dv de rut o código identificador contraparte	10	1	X(1)
nombre contraparte	11	50	X(50)
número de contrato	61	8	X(8)
fecha de suscripcion	69	8	AAAAMMDD
fecha de vencimiento	77	8	AAAAMMDD
número de días	85	4	9(4)
modalidad de pago	89	1	X(1) C ó E
codigo de moneda recibida	90	4	9(9)
monto recibido	94	18	9(14)v9(4)
código de moneda entregada	112	4	9999
monto entregado	116	18	9(14)v9(4)
precio spot	134	9	9(5)v9(4)
precio forward	143	9	9(5)v9(4)
Código instrumento	152	2	9(02)
Código sector económico contraparte	154	3	9(03)
Prima Total (Opciones)	157	14	9(10)v9(4)

2.3 Registro de control término

Largo registro : 151

CAMPO	Posc.	Largo	PIC
flag de control	1	10	X(10) (*)
Filler	11	141	X(141)

(*) Rellenar flag de control con "FFFFFFFFF"

OBSERVACIONES:

1. En el campo Código de Instrumento, se deberán ingresar, según corresponda, dos dígitos numéricos de acuerdo a la siguiente relación:

01: Forward
02: Futuro
03: Opción Call
04: Opción Put
05: Swap
06: Combinación
2. El campo "Prima Total (Opciones)" deberá completarse con ceros, cuando se trate de un instrumento distinto de "Opción" (Put o Call).
3. Los Usuarios que tengan alguna duda respecto al mencionado archivo computacional podrán canalizar sus inquietudes al Banco Central de Chile, enviando un e-mail a la cuenta de correo electrónico hmatus@bcentral.cl o alternativamente comunicándose con el Señor Hugo Matus M., Jefe de Proyecto de la Gerencia de Informática, al teléfono 670-2389.