



**SIID-TR**

Sistema Integrado de Información  
sobre Transacciones de Derivados

**Especificaciones Técnicas y Tablas  
relativas al Reglamento Operativo del  
Sistema**

**Integrado de Información sobre  
Transacciones de Derivados (RO-SIID-TR)**

## REGISTRO DE VERSIONES

<b>Nº VERSIÓN</b>	<b>FECHA</b>	<b>COMENTARIOS</b>
Versión 1.0	12-03-2020	
Versión 1.1	29-03-2021	Se realizan precisiones en algunos campos. Se especifica el reporte de información por parte de las Administradoras Generales de Fondos y Fondos de Pensiones.

## Contenido

I.	INTRODUCCIÓN.....	4
II.	FORMATO, NOMBRE DE ARCHIVOS Y <i>HEADER</i> .....	4
III.	TIPO DE REGISTRO DE LOS ARCHIVOS .....	4
IV.	FORMATOS MÁS IMPORTANTES .....	6
V.	TABLAS Y CÓDIGOS.....	6
VI.	FORMATO DE CAMPOS, SEGÚN SISTEMA O ACTIVO SUBYACENTE .....	6
VII.	EJEMPLO ARCHIVO REPORTE DIARIO- CSV .....	6
VIII.	ESTRUCTURA DE LOS ARCHIVOS REPORTADOS POR ADMINISTRADORAS DE FONDOS DE PENSIONES (AFPs), ADMINSTRADORAS GENERALES DE FONDOS (AGFs) Y REPORTANTES INDIRECTOS QUE INFORMAN A NOMBRE DE OTRA ENTIDAD. ....	10
	ANEXO 1: DETALLE DE TABLAS Y CÓDIGOS DEL SIID-TR .....	11
	Tabla 1: Naturaleza de la Información.....	12
	Tabla 2: Eventos de Reporte.....	12
	Tabla 3: Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente.....	12
	Tabla 4: Instrumentos.....	12
	Tabla 5: Clase de Opción.....	13
	Tabla 6: Tipo de Posición .....	13
	Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente.....	13
	Tabla 8: Modalidad de Liquidación.....	13
	Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés .....	13
	Tabla 10: Objetivo de la Operación .....	15
	Tabla 11: Convenio Marco.....	15
	Tabla 12: Garantías.....	15
	Tabla 13: Cláusula de <i>Recouping</i> .....	15
	Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado .....	15
	Tabla 15: Compresión de Cartera.....	16
	Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía .....	16
	Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado .....	16
	Tabla 18: Método de Valorización.....	17
	ANEXO 2.A: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE MONEDAS.....	18
	ANEXO 2.B: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE TASAS DE INTERÉS .....	36
	ANEXO 2.C: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA.....	53

## I. INTRODUCCIÓN

Este documento está dirigido a los distintos Participantes o agentes de mercado que, según el [Capítulo III.D.3](#) del Compendio de Normas Financieras, están obligados a reportar al Banco Central de Chile sus contratos de instrumentos derivados sobre monedas o tipos de cambios (incluyendo los CLP/UF), tasas de interés e instrumentos de renta fija. Estos Participantes son Bancos y sus filiales, Fondos de Pensiones, empresas del Sector Real, Corredoras de Bolsa, Agencias de Valores, Administradoras Generales de Fondos (AGFs), Compañías de Seguros, y cualquier otro intermediario financiero regulado por la Comisión para el Mercado Financiero (CMF), de acuerdo con lo indicado en el citado [Capítulo III.D.3](#). Adicionalmente, considera a residentes que efectúen transacciones de derivados con el exterior.

## II. FORMATO, NOMBRE DE ARCHIVOS Y HEADER

**Formato y Nombre:** Se solicita que los archivos sean enviados en formato CSV (*comma-separated values*). Respecto del nombre del archivo, no existen restricciones.

Cada archivo debe contener en la primera línea un *header*, de acuerdo con las siguientes especificaciones:

**Header:** largo 20 caracteres, con la estructura:

**XXXXXXXXXXCCCAAAMMDD**

Donde:

XXXXXXXXXX      Corresponde al RUT de la institución reportante en el SIID (sin guión y con dígito verificador).

CCC                Código del reporte según Tabla 1.

AAAMMDD        Fecha del reporte a la que se refieren los datos del archivo, indicando año, mes y día.

Tabla 1. Códigos, según tipo de reporte y subyacente

Código	Archivo o reporte
DFX	Diario sobre monedas
MFX	Mensual sobre monedas
DIR	Diario sobre tasas de interés
MIR	Mensual sobre tasas de interés
DFI	Diario sobre instrumentos de renta fija
MFI	Mensual sobre instrumentos de renta fija

## III. TIPO DE REGISTRO DE LOS ARCHIVOS

Luego del *header*, el archivo continúa con los registros sobre los contratos a reportar, los cuales se encuentran separados en ocho secciones detalladas en la Tabla 2. Para flexibilizar el reporte, no existe un requerimiento específico respecto del orden de recepción de las secciones de los archivos. Sin embargo, es necesario que cada línea inicie con los campos llaves (*Primary Key*), seguido de los campos de cada sección del archivo. Se debe considerar que, para las secciones sobre pagos y activos de garantías, podrá haber tantas líneas como tipos de pagos o activos de garantía, respectivamente, tenga el contrato reportado.

En el caso de los reportes diarios, la información solicitada por el RO-SIID, para todos sus sistemas (monedas, tasas de interés e instrumentos de renta fija) en las Secciones 1 sobre “Condiciones Financieras de la Operación”, según los numerales 1.A –Información General– y 1.B –Calendario de Flujos–, se han contenido en cuatro tipos de registros a identificar en los archivos CSV. Estos se encuentran consignados en la Tabla 3.

Por su parte, la información adicional requerida por el RO-SIID para los reportes mensuales, dispuesta en la Sección 2 sobre “Pagos del periodo”, Sección 3 relativa a “Garantías” y Sección 4 sobre “Valor de Mercado”; son contenidas en cuatro tipos de registros, según la Tabla 3.

Así, en la Tabla 3 se especifican los tipos de registros que deben ser reportados en los archivos diarios y

mensuales.

Tabla 2. Resumen de secciones de archivos

Tipo de registro	Descripción
01	Identificación del Contrato
02	Condiciones financieras generales del contrato
03	Condiciones financieras específicas del contrato
04	Calendario de flujos
05	Pagos
06	Garantías
07	Detalle tipo activo en garantía
08	Valorización a precios de mercado

Tabla 3. Resumen de secciones a enviar, según sistema y periodicidad de reporte

Normativa (RO-SIID)			Tipo de reporte, según periodicidad			
Sección Normativa	Nombre	Sistema o subyacente	Tipo de registro	Diario	Mensual	
					Vigente	Vencido
1.A: Información general		FX-IR-FI	01			
		FX-IR-FI	02			
		FX-IR-FI	03			
1.B: Calendario de flujos		FX-IR	04			
2: Pagos del periodo		FX-IR-FI	05			
3: Garantías		FX-IR-FI	06			
		FX-IR-FI	07			
4: Valor de mercado		FX-IR-FI	08			

Donde:

FX: Requerimiento del Sistema de monedas.

IR: Requerimiento del Sistema de tasas de interés.

FI: Requerimiento del Sistema de instrumentos de renta fija.

Junto a este documento, se entrega una descripción de cada uno de los campos que componen a cada tipo de sistema o subyacente (monedas, tasas de interés e instrumentos de renta fija), así como sus respectivos formatos. Lo anterior, según lo indicado en el RO-SIID ([Capítulo III.D.3.1](#)).

## IV. FORMATOS MÁS IMPORTANTES

Si bien en el Anexo 2 se detalla el formato de cada uno de los campos, a continuación, se presenta un resumen de los formatos de los campos más usados:

Consideraciones	Formato	Ejemplo
<b>Formato archivo</b>	CSV (comma-separated values)	
<b>Fecha</b>	Date: yyyy-mm-dd	2020-11-05
<b>Fecha Suscripción</b>	Datetime: yyyy-mm-ddThh:mm:ss	2020-11-05T14:31:46
<b>RUT</b>	Varchar(9) sin puntos, con dígito verificador y sin guion	999999999
<b>Montos</b>	Num(15,5), corresponde a un máximo de 15 enteros y a máximo de cinco decimales.	5000000.555
<b>Tasas /Spread</b>	Num(4,10), corresponde a un máximo de 4 enteros y a un máximo de 10 decimales.	2.75
<b>Separador de decimales</b>	". " (punto)	5000000.555
<b>Separador de miles</b>	Sin separador de miles.	5000000.555
<b>Separador de campos</b>	"; " (punto y coma)	5000000.555;USD
<b>Campos nulos o sin datos</b>	Se muestran sin espacios.	::
<b>Alineamiento de los campos</b>	Los campos se informan sin alinear, ya que están expresados con separadores de campo.	
<b>Tipo de registro</b>	Char(2) Orden de las secciones. Se recomienda que se informen en forma ascendente, pero se procesarán independientemente del orden.	01
<b>Monedas</b>	Norma ISO 4217, alpha -3. En el caso de la cotización <i>offshore</i> del Yuan considerar el código CNH.	CLP
<b>Países</b>	Norma ISO 3166-1, alpha -3	CHL
<b>Plataforma de negociación</b>	MIC "Market Identifier Code" Norma ISO 10383, alpha-4	XBCL
<b>Convenio marco</b>	Char(25) según Tabla 11 Convenio Marco + número convenio.	ISDA987654321
<b>Fin de línea</b>	Para finalizar el último valor de una línea de información, solo se informa el valor. No se debe agregar ningún carácter.	

## V. TABLAS Y CÓDIGOS

Para la elaboración de los archivos se deberá considerar el listado de tablas y códigos definidos en el Anexo 1, para cada uno de los Sistemas de Información o activo subyacente.

## VI. FORMATO DE CAMPOS, SEGÚN SISTEMA O ACTIVO SUBYACENTE

En los anexos 2.A, 2.B y 2.C, se detalla el formato de cada uno de los campos relevantes para cada uno de los Sistemas del SIID, junto con un ejemplo de dato.

## VII. EJEMPLO ARCHIVO REPORTE DIARIO- CSV

A continuación, se presenta un ejemplo de archivo CSV para un contrato que se debe informar en forma diaria, según el sistema de Monedas (FX).

Ejemplo: Se considera el siguiente contrato (datos ficticios y solo para fines referenciales):

### Información del contrato:

RUT contraparte 1	12345678-5
Tipo de envío	Diario
Fecha de envío	2021-01-15
Identificador del contrato	98765
Fecha de suscripción	2021-01-12 a las 14:31:46
Id. operación estructurada	0
Naturaleza de la información	Y

Evento de reporte	NUE
LEI contraparte 1	213800PM785MT657TJ13
RUT contraparte 2	98765432-5
LEI contraparte 2	213800FQ9YXIEP9GZG11
Nombre o razón social contraparte 2	ABCD
País contraparte 2	CHL
RUT de entidad de contraparte central	76317889-7
LEI de entidad de contraparte central	213800FQ9YXIEP9GZG11
RUT participante directo/agente liquidador de la entidad de contraparte central de la contraparte 1	76317889-7
LEI participante directo/agente liquidador de la entidad de contraparte central de la contraparte 1	213800FQ9YXIEP9GZG11
RUT agente de cálculo	76317889-7
LEI agente de cálculo	213800FQ9YXIEP9GZG11
Nombre o razón social agente de cálculo	ABCD
RUT del cedente o cesionario	No aplica
LEI cedente o cesionario	No aplica
Plataforma de negociación	XBCL
RUT intermediario	111111111
LEI intermediario	9695005RU7JILXCDUF47
Instrumento	CCS
Identificador del contrato para agente autorizado	No aplica
Opciones-Clase	No aplica
Opciones: Posición en la operación	No aplica
Modalidad de liquidación	CO
Moneda de compensación	USD
Fecha de inicio	2021-01-18
Fecha fixing 1	2025-01-17
Fecha de término	2025-01-20
Fecha de pago de la operación	2025-01-20
Fecha de inicio de la modificación	No aplica
Moneda de prima/pago inicial	No aplica
Monto prima/pago inicial recibida(o)	No aplica
Monto prima/pago inicial entregada(o)	No aplica
Objetivo de la operación	CFC
Convenio marco	CCGG123456
País jurisdicción del contrato	CHL
Garantías	CC
Cláusula de recouping	N
Cláusula de término anticipado	NOT
Fecha efectiva de término o liquidación anticipada	No aplica
Compresión de cartera	N
Número total de intercambios o flujos	4
Número total de registros de pagos	No aplica
Opciones: Instrumento subyacente	No aplica
Moneda comprada	USD
Monto moneda comprada	1000000
Moneda vendida	CLP
Monto moneda vendida	750000000
Tipo de tasa de interés a recibir	US0012M
Tipo de tasa de interés a entregar	TABU12M
Fecha fixing 2	No aplica
Convención tipo de cambio	USD/CLP
Precio pactado a futuro (tipo cambio futuro)	750
Puntos forward	-5
Precio barrera de entrada ( <i>Knock-in</i> )	No aplica
Precio barrera de salida ( <i>Knock-out</i> )	No aplica
Número total del flujo	2

Número del flujo	1
Tipo de flujo	R
Factor sobre tasa de interés variable	No Aplica
Spread sobre tasa de interés variable:	0.02
Tasa de interés fija	No aplica
Fecha de <i>fixing</i> para tasa de interés	2022-01-14
Fecha de inicio del flujo	2021-01-18
Fecha de término del flujo	2022-01-17
Monto nocional aplicable al flujo	1000000
Monto flujo como intercambio del capital	500000
Moneda del monto como intercambio de capital	USD
Número del flujo	1
Tipo de flujo	E
Factor sobre tasa de interés variable	No Aplica
Spread sobre tasa de interés variable:	0.05
Tasa de interés fija	No aplica
Fecha de <i>fixing</i> para tasa de interés	2022-01-14
Fecha de inicio del flujo	2021-01-18
Fecha de término del flujo	2022-01-17
Monto nocional aplicable al flujo	750000000
Monto flujo como intercambio del capital	375000000
Moneda del monto como intercambio de capital	CLP
Número del flujo	2
Tipo de flujo	R
Factor sobre tasa de interés variable	No Aplica
Spread sobre tasa de interés variable:	0.02
Tasa de interés fija	No aplica
Fecha de <i>fixing</i> para tasa de interés	2023-01-13
Fecha de inicio del flujo	2022-01-17
Fecha de término del flujo	2023-01-16
Monto nocional aplicable al flujo	500000
Monto flujo como intercambio del capital	500000
Moneda del monto como intercambio de capital	USD
Número del flujo	2
Tipo de flujo	E
Factor sobre tasa de interés variable	No Aplica
Spread sobre tasa de interés variable:	0.05
Tasa de interés fija	No aplica
Fecha de <i>fixing</i> para tasa de interés	2023-01-13
Fecha de inicio del flujo	2022-01-17
Fecha de término del flujo	2023-01-16
Monto nocional aplicable al flujo	375000000
Monto flujo como intercambio del capital	375000000
Moneda del monto como intercambio de capital	CLP



**Ejemplo del contenido del archivo diario CSV del contrato anterior:**

123456785DFX20210115  
1;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;Y;NUE;213800PM785MT657TJ13;987654325;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;CHL;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;;;XBCL;111111111;9695005RU7JILXCDEF47  
2;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;CCS;;;CO;USD;2021-01-18;2023-01-13;2023-01-16;2023-01-16;;;;CFC;CCGG123456;CHL;CC;N;NOT;;N;2;  
3;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;;USD;1000000;CLP;750000000;US0012M;TABU12M;;USD/CLP;750;-5;;  
4;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;1;R;;0.02;;2022-01-14;2021-01-18;2022-01-17;1000000;500000;USD  
4;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;1;E;;0.05;;2022-01-14;2021-01-18;2022-01-17;750000000;375000000;CLP  
4;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;2;R;;0.02;;2023-01-13;2022-01-17;2023-01-16;500000;500000;USD  
4;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;2;E;;0.05;;2023-01-13;2022-01-17;2023-01-16;375000000;375000000;CLP

## VIII. ESTRUCTURA DE LOS ARCHIVOS REPORTADOS POR ADMINISTRADORAS DE FONDOS DE PENSIONES (AFPs), ADMINISTRADORAS GENERALES DE FONDOS (AGFs) Y REPORTANTES INDIRECTOS QUE INFORMAN A NOMBRE DE OTRA ENTIDAD.

Las Administradoras de Fondos de Pensiones (AFP) y las Administradoras Generales de Fondos (AGF) deben reportar a nombre de cada uno de sus fondos. Para esto, la cabecera (*header*) del archivo debe contener el RUT de la entidad que está enviando el reporte de información. Mientras que los campos asociados a la identificación de la Contraparte 1, se deberán llenar de acuerdo con la siguiente tabla:

Institución Reportante	RUT <i>Header</i>	RUT Contraparte 1	Razón Social Contraparte 1	LEI Contraparte 1
AFP	Rut AFP	Rut AFP	Razón social de la AFP	Código LEI del Fondo de la AFP. (Ejemplo: Código LEI del Fondo A de una AFP)
AGF	Rut AGF	Rut del fondo administrado por la AGF	Razón social del fondo administrado por la AGF	Código LEI del Fondo administrado por la AGF, en caso que el fondo disponga de uno, en el caso contrario, el código de LEI de la AGF, de contar con uno.

En el caso de que una AGF o AFP decida que su información sea enviada a través de un Reportante Indirecto o Agente Autorizado, la cabecera (*header*) del archivo deberá llevar el RUT del Reportante Indirecto o Agente Autorizado, mientras que los datos referentes a la Contraparte 1, se completarán según la señalado en la tabla anterior.

Por ejemplo, para una AGF de RUT 60.000.000-4, que administra tres fondos, con los RUTS: 61.000.000-2, 62.000.000-0 y 63.000.000-9, un ejemplo de archivo mensual es el siguiente:

```
600000004MFX20201130
1;610000002;Id_000126798;2020-10-01T10:35:47;0;Y;MVI;;500000007;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;CHL;;;;;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;Agente de cálculo;;;OTC;;
1;620000000;Id_000126472;2020-10-02T09:15:04;0;Y;MVI;;500000007;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;CHL;;;;;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;Agente de cálculo;;;OTC;;
1;630000009;Id_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;Y;MVI;;500000007;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;CHL;;;;;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;Agente de cálculo;;;OTC;;
2;610000002;Id_000126798;2020-10-01T10:35:47;0;FWD;;;;CO;USD;2020-10-02;2021-01-12;2021-01-13;2021-01-14;;;;;CFC;isda12345;CHL;SC;N;NOT;;N;1;0
2;620000000;Id_000126472;2020-10-02T09:15:04;0;FWD;;;;CO;USD;2020-10-03;2021-01-13;2021-01-14;2021-01-14;;;;;CFC;isda6789;CHL;SC;N;NOT;;N;1;0
2;630000009;Id_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;FWD;;;;CO;USD;2020-10-06;2021-01-13;2021-01-14;2021-01-14;;;;;CFC;isda9876;CHL;SA;N;NOT;;N;1;0
3;610000002;Id_000126798;2020-10-01T10:35:47;0;;USD;2000000;CLP;1516000000;;;;;USD/CLP;758;-1.57;;
3;620000000;Id_000126472;2020-10-02T09:15:04;0;;USD;1000000;CLP;747320000;;;;;USD/CLP;747.32;3.67;;
3;630000009;Id_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;;USD;4000000;CLP;2930680000;;;;;USD/CLP;732.67;3.67;;
6;630000009;Id_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;E;CLP;Portafolio_Id_1234;500000;467903.274
7;630000009;Id_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;E;Portafolio_Id_1234;BBCH;55
7;630000009;Id_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;E;Portafolio_Id_1234;BTGR;45
8;610000002;Id_000126798;2020-10-01T10:35:47;0;M;USD;147984.2365;;;;;24560;;5650
8;620000000;Id_000126472;2020-10-02T09:15:04;0;M;USD;67894.382;;;;;24560;;5650
```

## ANEXOS

### ANEXO 1: DETALLE DE TABLAS Y CÓDIGOS DEL SIID-TR

#### 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 Recouping
- 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

Tabla 1: Naturaleza de la Información

Descripción	Código
El Evento de Reporte se comunica en cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos I y IX del CNCI, sobre operaciones con instrumentos derivados, o en la normativa cambiaria sobre operaciones con instrumentos derivados que en el futuro pueda modificar o sustituir dicha regulación, incluyendo a este respecto los requerimientos de información cambiaria que contenga el Capítulo III.D.3 del CNF.	Y
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.	N

Tabla 2: Eventos de Reporte

Numeral	Descripción	Código
2.1.1	Nuevo contrato	NUE
2.1.2	Adquisición por cesión	ACS
2.2.1	Modificación por <i>recouponing</i>	MRC
2.2.2	Modificación de contraparte por cesión	MCS
2.2.3	Otras modificaciones	OMD
2.2.4	Modificación por corrección de reporte	MCR
2.3.1	Término por caducidad, anticipo o resciliación	AOC
2.3.2	Término por cesión	CES
2.3.3	Término por anulación	ANU
2.3.4	Mensual operaciones vencidas	MVE
2.4.1	Mensual operaciones vigentes	MVI

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

Descripción	Código
<i>International Securities Identification Number (ISIN)</i>	ISI
Nemotécnico	NEM
<i>Alternative Instrument Identifier (AII)</i>	AII
<i>Committee on Uniform Securities Identification (CUSIP)</i>	CUS
<i>Stock Exchange Daily Official List (SEDOL)</i>	SED
Otro	OTR

Tabla 4: Instrumentos

Descripción	Subsistema al que aplica	Código
<i>Cross Currency Swap</i>	I (Monedas)	CCS
<i>Forward</i> Observado	I (Monedas)	FOB
<i>FX Swap</i>	I (Monedas)	FXS
Futuro	I, II y III (Monedas, Tasas de Interés y Renta fija, respectivamente)	FUT
<i>Forward</i>	I, II y III (Monedas, Tasas de Interés y Renta fija, respectivamente)	FWD
<i>Swaption</i>	I y II (Monedas y Tasas de Interés, respectivamente)	STN
Opción <i>Call</i>	I (Monedas)	CAL
Opción <i>Put</i>	I (Monedas)	PUT
Opción <i>Cap</i>	II y III (Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente)	CAP
Opción <i>Floor</i>	II y III (Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente)	FLR
<i>Interest Rate Swap</i>	II (Tasa de Interés)	SWP
Otros	I, II y III (Monedas, Tasas de Interés y Renta fija, respectivamente)	OTR

Tabla 5: Clase de Opción

Descripción	Código
Americana	AM
Bermuda	BE
Europea	EU
Asiática	AS
Otras	OT

Tabla 6: Tipo de Posición

Descripción	Código
Compradora	BYER
Vendedora	SLLR

Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente

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

Tabla 8: Modalidad de Liquidación

Descripción	Código
Compensación	CO
Entrega Física	EF

Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés

Descripción	Código
Tasa fija	FIXEDRT
TNA o Tasa nominal anual (Índice Cámara Promedio –ABIF/GRSS–)	TNAICPO
TRA o Tasa real anual (Índice Cámara Promedio Real –ABIF/GRSS–)	TRAICPO
TAB en UF a 90 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo reajustables en UF –ABIF/GRSS–)	TABUF3M
TAB en UF a 180 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo reajustables en UF a 180 días –ABIF/GRSS–)	TABUF6M
TAB en UF a 360 días (Tasa de interés promedio ponderada de captaciones reajustables en UF a 360 días –ABIF/GRSS–)	TABU12M
TAB nominal a 30 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en pesos chilenos. –ABIF/GRSS–)	TABN01M
TAB nominal a 90 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en pesos chilenos –ABIF/GRSS–)	TABN03M
TAB nominal a 180 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en pesos chilenos –ABIF/GRSS–)	TABN06M
TAB nominal a 360 días (Tasa de interés promedio ponderada de captaciones en pesos chilenos a 360 días. –ABIF/GRSS–)	TABN12M
TADO a 30 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO01M
TADO a 60 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO02M
TADO a 90 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO03M
TADO a 180 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO06M
TADO a 360 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO12M
<i>Prime Rate</i>	PRIMERT
LIBOR en Dólares de los EE.UU. <i>overnight</i> (ICE)	US000ON

Descripción	Código
LIBOR en Dólares de los EE.UU. a 30 días (ICE)	US0001M
LIBOR en Dólares de los EE.UU. a 7 días (ICE)	US0001W
LIBOR en Dólares de los EE.UU. a 60 días (ICE)	US0002M
LIBOR en Dólares de los EE.UU. a 90 días (ICE)	US0003M
LIBOR en Dólares de los EE.UU. a 180 días (ICE)	US0006M
LIBOR en Dólares de los EE.UU. a 360 días (ICE)	US0012M
SOFR ( <i>Secured Overnight Financing Rate</i> )	SOFRATE
EFFR ( <i>Federal Funds Effective Rate</i> )	FEDFUND
OBFR ( <i>United States Overnight Bank Funding Rate</i> )	USOBFRT
Tasa de la curva de rendimiento del Tesoro de los EE.UU. a 10 años	USTN10Y
Tasa de la curva de rendimiento del Tesoro de los EE.UU. a 3 años	USTN03Y
LIBOR en Euros overnight (ICE)	EE000ON
LIBOR en Euros a 7 días (ICE)	EE0001W
LIBOR en Euros a 30 días (ICE)	EE0001M
LIBOR en Euros a 60 días (ICE)	EE0002M
LIBOR en Euros a 90 días (ICE)	EE0003M
LIBOR en Euros a 180 días (ICE)	EE0006M
LIBOR en Euros a 360 días (ICE)	EE0012M
€STER ( <i>Euro Short-Term Rate</i> )	ESTERON
Euribor a 1 semana	EUR001W
Euribor a 2 semanas	EUR002W
Euribor a 30 días	EUR001M
Euribor a 60 días	EUR002M
Euribor a 90 días	EUR003M
Euribor a 180 días	EUR006M
Euribor a 270 días	EUR009M
Euribor a 12 meses	EUR012M
EONIA ( <i>Euro Overnight Index Average</i> )	EONIAON
LIBOR en Libras esterlinas <i>overnight</i> (ICE)	BP000ON
LIBOR en Libras esterlinas a 7 días (ICE)	BP0001W
LIBOR en Libras esterlinas a 30 días (ICE)	BP0001M
LIBOR en Libras esterlinas a 60 días (ICE)	BP0002M
LIBOR en Libras esterlinas a 90 días (ICE)	BP0003M
LIBOR en Libras esterlinas a 180 días (ICE)	BP0006M
LIBOR en Libras esterlinas a 360 días (ICE)	BP0012M
SONIA ( <i>Sterling Overnight Interbank Average Rate</i> )	SONIAON
LIBOR en Francos suizos spot next day (ICE)	SF000ON
LIBOR en Francos suizos a 7 días (ICE)	SF0001W
LIBOR en Francos suizos a 30 días (ICE)	SF0001M
LIBOR en Francos suizos a 60 días (ICE)	SF0002M
LIBOR en Francos suizos a 90 días (ICE)	SF0003M
LIBOR en Francos suizos a 180 días (ICE)	SF0006M
LIBOR en Francos suizos a 360 días (ICE)	SF0012M
SARON ( <i>Swiss Average Rate Overnight</i> )	SWAVRON
Libor en Yenes japoneses spot <i>next day</i> (ICE)	JY000ON
Libor en Yenes japoneses a 7 días (ICE)	JY0001W
Libor en Yenes japoneses a 30 días (ICE)	JY0001M
Libor en Yenes japoneses a 60 días (ICE)	JY0002M
Libor en Yenes japoneses a 90 días (ICE)	JY0003M
Libor en Yenes japoneses a 180 días (ICE)	JY0006M
Libor en Yenes japoneses a 360 días (ICE)	JY0012M
TONA ( <i>Tokyo Overnight Average Rate</i> )	TKAVRON
Otros	OTHERRT

Tabla 10: Objetivo de la Operación

Descripción	Código
Negociación	NEG
Cobertura de Riesgo de Posiciones del Balance	CPB
Cobertura Contable Valor Razonable	CVR
Cobertura Contable Flujo de Caja	CFC
Cobertura Contable de Inversiones Netas en el Exterior	CIE

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	Código*
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.	CCGG + número de contrato marco.
International Swaps and Derivatives Association.	ISDA + número de contrato marco
Otros convenios no contemplados previamente.	OTRO + número de contrato marco
No está sujeto a convenio marco.	NOSU

\*: Este campo permite un máximo de 25 caracteres. De los cuales los primeros cuatro corresponden al convenio marco definido en la Tabla Convenio Marco y los restantes deben ser utilizados para indicar el número o código único asignado al convenio marco de contratación de derivados, según corresponda.

Tabla 12: Garantías

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

Tabla 13: Cláusula de *Recouping*

Descripción	Código
Con cláusula de <i>Recouping</i>	Y
Sin cláusula de <i>Recouping</i>	N

Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado

Descripción	Código
A favor de la Contraparte 1, con liquidación	CO1
A favor de la Contraparte 1, sin liquidación	C1S
A favor de la Contraparte 2, con liquidación	CO2

A favor de la Contraparte 2, sin liquidación	C2S
Opcional ambas partes, con liquidación	AMP
Opcional ambas partes, sin liquidación	AMS
Sin cláusula de término anticipado	NOT

Tabla 15: Compresión de Cartera

Descripción	Código
Contrato es resultado de una compresión de cartera	Y
Contrato no es resultado de una compresión de cartera	N

Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía

Descripción	Código
Efectivo	CASH
Depósitos	DEPO
Bonos Corporativos	BCOR
Bonos del Banco Central de Chile	BBCH
Bonos de la Tesorería General de la República de Chile	BTGR
Bonos Soberanos Extranjeros	BSEX
Bonos Corporativos Extranjeros	BCOX
Acciones	ACCS
Bienes Inmuebles	BSIM
Otras garantías	OTRO

Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado

Descripción	Código
Pago o intercambio de intereses (aplica para entrega física y compensación)	I
Pago o intercambio de principales (aplica para entrega física y compensación)	C
Prima o pago realizado al inicio del contrato	P
Pago originado por el cierre anticipado del contrato	A
Pago originado por <i>recouping</i>	R
Otros	O



Tabla 18: Método de Valorización

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

## ANEXO 2.A: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE MONEDAS

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
<b>1.A. Información general</b>							
	01				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	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.	Datetime	No
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			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 I y IX del CNCI, o en la normativa cambiaria sobre operaciones con instrumentos derivados, que en el futuro pueda modificar o sustituir dicha regulación, según Tabla Naturaleza de la Operación.	Char(1)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			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>2.1 Suscripción  2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante.  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. 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>2.2 Modificación  Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante.  2.2.1 Recouping: Modificación de las condiciones financieras de un Contrato a consecuencia de pagos que hacen las partes con el objeto de modificar su valor razonable (mark to market).  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.  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.  2.2.4 Corrección de reporte: Rectificación de información enviada previamente por el Participante que no corresponda a una modificación contractual.</p> <p>2.3 Término  Corresponde al evento de terminación o pérdida de vigencia de una operación reportada previamente por el Participante, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.  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>	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			2	Evento de Reporte	<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>2.4 Vigencia 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>	Char(3)	No
			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.	Char(20)	Si
			5	RUT contraparte del participante (Contraparte 2)	RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar.	Varchar(9)	Si, solo cuando la contraparte 2 es extranjera.
			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.	Char(20)	Si, solo cuando la contraparte 2 es extranjera.
			7	Nombre o razón social contraparte 2	Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.	Varchar(150)	No
			8	País Contraparte 2	Código del país de residencia o domicilio de la Contraparte 2, de acuerdo con la norma ISO 3166-1 alpha-3	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			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.	Varchar(9)	Si, cuando garantías es distinto de CC.
			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.	Char(20)	Si, cuando garantías es distinto de CC.
			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.	Varchar(9)	Si
			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.	Char(20)	Si
			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.	Varchar(9)	Si
			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.	Char(20)	Si
			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.	Varchar(150)	Si

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			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. Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.	Varchar(9)	Si, cuando evento de reporte es distinto de CES y ACS.
			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. Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.	Char(20)	Si, cuando el evento de reporte es distinto de CES y ACS.
			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. En el caso que el contrato fuese negociado fuera de Bolsa, se deberá indicar en este campo el código "OTC".	Char(4)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			57	RUT Intermediario	RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario ( <i>Broker</i> ) que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Varchar(9)	Si
			58	LEI Intermediario	Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ), si lo tuviere, del <i>Broker</i> que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Char(20)	Si
	<b>02</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	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.	Datetime	No
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	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). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			21	Instrumento	Tipo de instrumento al que corresponde la operación informada, según la Tabla de Instrumentos.	Char(3)	No
			19	Identificador del contrato para agente autorizado	Código único asignado por el Agente Autorizado a cada Contrato suscrito por el Participante. Este campo puede ser informado solo cuando el envío de información al SIID sea realizado por un Agente Autorizado a nombre del Participante.	Varchar(52)	Si

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			22	Opciones: Clase	Clase de opción a que corresponde la operación informada, de acuerdo con la modalidad de ejercicio pactada en el Contrato, según lo señalado en la Tabla Clase de Opción.	Char(2)	Si, cuando el instrumento no es una opción.
			23	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.	Char(4)	Si, cuando el instrumento no es una opción.
			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	Char(2)	No
			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.	Char(3)	Si, cuando la modalidad de liquidación es por entrega
			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 flujos.	Date	No
			35	Fecha <i>fixing</i> 1	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. En el caso de haber más intercambios se debe indicar la fecha de fixing para cada uno de los flujos en la sección de calendario de flujos. 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.	Date	Si, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física.
			37	Fecha de término	Fecha en la cual vence o madura la operación de acuerdo con 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".	Date	No
			38	Fecha de pago de la operación	Fecha de la última liquidación de la operación.	Date	No
			39	Fecha de inicio de la Modificación	Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una Modificación.	Date	Si, cuando el evento de reporte no es una modificación.



Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			43	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 del Contrato, se debe indicar la moneda de dicho pago. En el caso de tratarse de un evento de reporte que consista en la "adquisición por cesión" de un Contrato, si el Participante (Contraparte 1) ha entregado o recibido un pago debe indicar la moneda de este. Se debe indicar el código de la moneda, según norma ISO 4217.	Char(3)	Si
			44	Monto prima/pago inicial recibida(o)	Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos en caso de tratarse de la "adquisición por cesión" del Contrato.	Num(15,5)	Si
			45	Monto prima/pago inicial entregada(o)	Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos en caso de tratarse de la "adquisición por cesión" del Contrato.	Num(15,5)	Si
			48	Objetivo de la operación	Indicar el objetivo de la operación para la Contraparte 1, según lo indicado en la Tabla Objetivo de la Operación. Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá reportar esta clasificación de acuerdo con la norma sectorial correspondiente.	Char(3)	No
			49	Convenio Marco	Este campo permite un máximo de 25 caracteres, de los cuales los primeros cuatro caracteres corresponden al convenio marco definido en la Tabla Convenio Marco y en los restantes caracteres se debe indicar el número o código único asignado al Convenio Marco de contratación de derivados.	Char(25)	No
			50	País Jurisdicción del Contrato	Código del país correspondiente a la legislación y jurisdicción aplicable bajo la cual el Contrato está amparado, de acuerdo con la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)	No
			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.	Char(4)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			52	Cláusula de Recouponing	Indicar si la operación considera o no cláusula de Recouponing en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de Recouponing.	Char(1)	No
			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.	Char(3)	No
			54	Fecha de efectiva de término o liquidación anticipada	Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.	Date	Si
			55	Compresión de cartera	Identificar si el nuevo Contrato o el término anticipado de uno previamente informado es resultado o no de una compresión u optimización de cartera.	Char(1)	No
			59	Número total de intercambios o flujos	Número total de oportunidades (fechas) en las que se ha convenido efectuar liquidaciones correspondientes a intercambio de flujo y/o notional. Los intercambios Spot no deben ser informados en este Sistema. En el caso de operaciones que comprenden más de un intercambio a futuro, estos deberán ser detallados a continuación en la sección de Calendario de Flujos. Para un instrumento que se compone de un único intercambio o liquidación a futuro, este campo debe ser reportado con valor 1.	Num(4)	No
			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. En el caso de agrupar (netear) distintos eventos de pagos, estos deberán corresponder a un mismo tipo, de acuerdo con la Tabla Tipo de Pago Efectuado	Num(5)	No (no aplica a archivos diarios).
	<b>03</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
		SI	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 (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. 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.	Varchar(52)	No
		SI	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.	Datetime	No
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	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). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			24	Opciones: Instrumento subyacente	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.	Char(3)	Si, solo si el instrumento no es una opción.
			27	Moneda Comprada	Código de la moneda subyacente a recibir por la Contraparte 1 en cada fecha de pago o al término de la operación, según norma ISO 4217.	Char(3)	No
			28	Monto Moneda Comprada	Monto de la moneda subyacente a recibir por la Contraparte 1 al término de la operación.	Num(15,5)	No
			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	Char(3)	No
			30	Monto Moneda Vendida	Monto de la moneda subyacente a entregar por la Contraparte 1 al término de la operación.	Num(15,5)	No
			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.	Char(7)	Si, solo si el instrumento es distinto de CCS.
			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.	Char(7)	Si, solo si el instrumento es distinto de CCS.

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			36	Fecha <i>fixing</i> 2	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”.	Date	Si
			40	Convención Tipo de Cambio	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 “/” .	Char(7)	No
			41	Precio Pactado a Futuro (Tipo Cambio Futuro)	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 Precio Strike. 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.	Num(15,5)	Si, para instrumentos distintos de FWD, FXS y FUT.
			42	Puntos Forward	Diferencia entre el Precio Pactado a Futuro y el Precio Spot considerado en la negociación.	Num(4,10)	Si, para instrumentos distintos de FWD.
			46	Precio barrera de entrada ( <i>Knock-in</i> )	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción podrá ser ejercida. 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).	Num(15,5)	Si
			47	Precio barrera de salida ( <i>Knock-out</i> )	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción no podrá ser ejercida. 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.	Num(15,5)	Si
<b>1.B. Calendario de Flujos</b>							
	<b>04</b>				<b>Tipo de registro</b>	<b>Char(2)</b>	<b>No</b>
		SI	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).	Varchar(9)	<b>No</b>

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
		SI	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 (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. 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.	Varchar(52)	No
		SI	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.	Datetime	No
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	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). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			60/70	Número del flujo	Correlativo del número del flujo a recibir/entregar a futuro por la Contraparte 1, ya sea por intercambio del principal o pago de intereses.	Num(4)	No
				Tipo de flujo	Código del tipo de flujo que se está reportando. E: entrega - R: recibido	Char(1)	No
			61/71	Factor sobre Tasa de Interés Variable	Factor que multiplica la tasa variable que recibe/entrega la Contraparte 1.	Num(4,3)	Si
			62/72	Spread sobre tasa de interés variable	Spread que recibe/entrega la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable	Num(4,10)	Si, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo no es variable.
			63/ 73	Tasa de interés fija	Tasa de interés fija a recibir/entregar por la Contraparte 1.	Num(4,10)	Si, cuando el tipo de tasa que aplica al fujo no es fija.
			64/74	Fecha de fixing para tasa de interés	Fecha que se considera para la tasa de interés variable de referencia utilizada en el cálculo de intereses del flujo a recibir/entregar por la Contraparte 1, según se estipule en el Contrato.	Date	No
			65/75	Fecha de inicio del flujo	Fecha de inicio del período durante el cual se devengarán los intereses del flujo a recibir/Entregar por la Contraparte 1.	Date	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			66/76	Fecha de término del flujo	Fecha de término del período durante el cual se devengarán intereses para el flujo que será recibido/entregado por la Contraparte 1.	Date	No
			67/77	Monto nocional aplicable al flujo	Monto nocional que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a recibir/entregar por la Contraparte 1.	Num(15,5)	No
			68/78	Monto flujo como intercambio del capital	Monto recibido/entregado por la Contraparte 1 en el flujo respectivo, producto del intercambio de capital o principal.	Num(15,5)	Si
			69/79	Moneda del monto como intercambio de capital	Código de la moneda del monto a recibir/entregar como intercambio de capital o principal, según norma ISO 4217.	Char(3)	Si, cuando monto flujo como intercambio del capital va vacío.
	<b>05</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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 (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. 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.	Varchar(52)	No
		SI	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.	Datetime	No
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			81	Correlativo de registro de pago	Correlativo del registro de pago a informar.	Num(5)	No
				Pago recibido/entregado (R/E)	Código del tipo de pago que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			82	Fecha de pago	Fecha de pago o liquidación. En el caso de informar más de un pago como registro agrupado, indicar la fecha correspondiente al pago más reciente.	Date	No
			83/84	Monto pago (recibido/entregado)	Monto recibido/entregado por la Contraparte 1, de acuerdo con lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. 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.	Num(15,5)	No
			85	Tipo de pago efectuado	Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado.	Char(1)	No
	<b>06</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	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.	Datetime	No
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	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). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			86	Moneda de valorización de la garantía	Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217. 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.	Char(3)	No
			87/91	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida/entregada	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas 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. 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.	Varchar(52)	No
			89/93	Monto umbral ("Threshold") recibida/entregada	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). 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.	Num(15,5)	Si
			90/94	Valor garantía (recibida/entregada)	Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas, vigentes al cierre del mes, constituidas a favor o 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. 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.	Num(15,5)	No
	<b>07</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	
		SI	3	RUT Participante (Contraparte)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SI	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 (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. 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.	Varchar(52)	No



Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
		SI	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.	Datetime	No
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	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). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			87;91	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida/entregada	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías entregadas/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. 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.	Varchar(52)	No
			88;92	Tipo activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(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. 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.	Char(4)	No
			88;92	Porcentaje tipo de activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(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. 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.	Num(3)	No
	<b>08</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
		SI	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 (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. 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.	Varchar(52)	No
		SI	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.	Datetime	No
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			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.	Char(1)	No
			96	Moneda de valorización	Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.	Char(3)	No
			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. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen. 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.	Num(15,5)	No
			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.	Num(4,10)	Si
			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: $\Delta = \partial V / \partial S$ ).	Num(4,10)	Si

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			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: $\Gamma = \partial\Delta/\partial S = \partial^2V/\partial S^2$ ).	Num(4,10)	Si
			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: $v = \partial V/\partial \sigma$ ).	Num(4,10)	Si
			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. En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones respecto de la Contraparte 2, o un grupo de contrapartes, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)	Si
			103	Ajuste a la valorización por <i>BID-OFFER Spread</i>	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por <i>BID-OFFER Spread</i> de la cartera de contratos de derivados de monedas, para la Contraparte 1. 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.	Num(15,5)	Si
			104	Otros ajustes a la valorización	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. 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.	Num(15,5)	Si

## ANEXO 2.B: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE TASAS DE INTERÉS

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
<b>1.A. Información general</b>							
	<b>01</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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 (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. 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.	Varchar(52)	No
		SI	31	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.	Datetime	No
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			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 I y IX del CNCI, o en la normativa cambiaria sobre operaciones con instrumentos derivados, que en el futuro pueda modificar o sustituir dicha regulación, según Tabla Naturaleza de la Operación.	Char(1)	No
			2	Evento de reporte	Código que identifica el tipo de registro que será informado o reportado, según la Tabla Eventos de Reporte. Este podrá corresponder a: 2.1 Suscripción 2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante.	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
					<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>2.2 Modificación</p> <p>Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante.</p> <p>2.2.1 Recouponing: Modificación de las condiciones financieras de un Contrato a consecuencia de pagos que hacen las partes con el objeto de modificar su valor razonable (mark to market).</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> <p>2.3 Término</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>	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
					<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>2.4 Vigencia 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>		
			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.	Char(20)	Si
			5	RUT Contraparte del Participante (Contraparte	RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar.	Varchar(9)	Si, solo si la contraparte 2 es extranjera.
			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.	Char(20)	Si, solo si la contraparte 2 es local.
			7	Nombre o Razón Social Contraparte 2	Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.	Varchar(150)	No
			8	País Contraparte 2	Código del país de residencia o domicilio de la Contraparte 2, de acuerdo con la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)	No
			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.	Varchar(9)	Si, solo si garantía es distinta de CC.
			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.	Char(20)	Si, solo si garantía es distinta de CC.
			1	RUT Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1	n 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.	Varchar(9)	Si

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			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.	Char(20)	Si
			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.	Varchar(9)	Si
			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	Char(20)	Si
			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.	Varchar(150)	Si
			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. Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.	Varchar(9)	Si, solo si evento de reporte es distinto de CES y ACS.
			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. Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.	Char(20)	Si, solo si evento de reporte es distinto de CES y ACS.
			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. En el caso que el contrato fuese negociado fuera de Bolsa, se deberá indicar en este campo el código "OTC".	Char(4)	No
			55	RUT Intermediario	RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario (Broker) que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Varchar(9)	Si
			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.	Char(20)	Si

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
	<b>02</b>				<b>Tipo de registro</b>	<b>Char(2)</b>	<b>No</b>
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	31	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.	Datetime(9)	No
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			21	Instrumento	Tipo de instrumento al que corresponde la operación informada, según la Tabla de Instrumentos.	Char(3)	No
			19	Identificador del contrato para agente autorizado	Código único asignado por el Agente Autorizado a cada Contrato suscrito por el Participante. Este campo puede ser informado solo cuando el envío de información al SIID sea realizado por un Agente Autorizado a nombre del Participante.	Varchar(52)	Si
			22	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.	Char(2)	Si, solo si el instrumento no es una opción.
			23	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.	Char(4)	Si, solo si el instrumento no es una opción.
			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	Char(2)	No
			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.	Char(3)	Si, solo si modalidad de liquidación es entrega física.



Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			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 para instrumentos distintos de Interest Rate Swap y que consideren un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contrario, se debe indicar la fecha de inicio para cada uno de los flujos en la sección de calendario de flujos. De haber más intercambios se debe indicar la fecha de inicio para cada uno de los flujos en la sección de calendario de pagos.	Date	No
			33	Fecha de Fixing	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. Este campo debe ser informado para instrumentos distintos de Interest Rate Swap y que considera un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contrario se debe indicar la fecha de fixing para cada uno de los flujos en la sección de calendario de flujos.	Date	Si, solo si modalidad de liquidación es entrega física.
			34	Fecha de término	Fecha en la cual vence o madura la operación de acuerdo con 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".	Date	No
			35	Fecha de pago de la operación	Fecha de la última liquidación de la operación.	Date	No
			36	Fecha de inicio de la Modificación	Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una Modificación.	Date	Si, solo si evento de reporte no es una modificación.
			41	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 del Contrato, se debe indicar la moneda de dicho pago. En el caso de tratarse de un evento de reporte que consista en la "adquisición por cesión" de un Contrato, si el Participante (Contraparte 1) ha entregado o recibido un pago debe indicar la moneda de este. Se debe indicar el código de la moneda, según norma ISO 4217.	Char(3)	Si
			42	Monto prima/pago inicial recibida(o)	Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos en caso de tratarse de la "adquisición por cesión" del Contrato.	Num(15,5)	Si
			43	Monto prima/pago inicial entregada(o)	Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos en caso de tratarse de la "adquisición por cesión" del Contrato.	Num(15,5)	Si

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			46	Objetivo de la operación	Indicar el objetivo de la operación para la Contraparte 1, según lo indicado en la Tabla Objetivo de la Operación. Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá reportar esta clasificación de acuerdo con la norma sectorial correspondiente.	Char(3)	No
			47	Convenio Marco	Este campo permite un máximo de 25 caracteres, de los cuales los primeros cuatro caracteres corresponden al convenio marco definido en la Tabla Convenio Marco y en los restantes caracteres se debe indicar el número o código único asignado al Convenio Marco de contratación de derivados.	Char(25)	No
			48	País Jurisdicción del Contrato	Código del país correspondiente a la legislación y jurisdicción aplicable bajo la cual el Contrato está amparado, de acuerdo con la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)	No
			49	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.	Char(4)	No
			50	Cláusula de Recouponing	Indicar si la operación considera o no cláusula de Recouponing en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de Recouponing.	Char(1)	No
			51	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.	Char(3)	No
			52	Fecha de efectiva de término o liquidación anticipada	Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.	Date	Si
			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.	Char(1)	No
			57	Número total de intercambios o flujos	Número total de oportunidades (fechas) en las que se ha convenido efectuar liquidaciones futuras correspondientes a intercambio de flujo y/o nocional. En el caso de operaciones que comprende más de un intercambio a futuro o corresponden a instrumentos <i>Interest Rate Swap</i> , estos deberán ser detallados a continuación en la sección de Calendario de Flujos.  Para un instrumento que se compone de un único intercambio o liquidación a futuro, este campo debe ser reportado con valor 1.	Num(4)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			76	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. En el caso de agrupar (netear) distintos eventos de pagos, estos deberán corresponder a un mismo tipo, de acuerdo con la Tabla Tipo de Pago Efectuado.	Num(5)	No (no aplica a archivos diarios).
	<b>03</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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 (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. 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.	Varchar(52)	No
		SI	31	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. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Datetime	No
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	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). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.	Num(2)	No
			24	Opciones: Instrumento subyacente	Indicar si el ejercicio de la opción implica la entrada en vigencia de un nuevo derivado (ejemplo swaption). Si este es el caso, reportar el instrumento subyacente correspondiente, según lo señalado en la Tabla Opciones - Instrumento Subyacente.	Char(3)	Si, solo si el instrumento no es una opción.
			27	Moneda monto nocional	Código de la moneda en la que esta expresado el monto nocional sobre el cual se calculan los intereses a intercambiar, según norma ISO 4217.	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			28	Monto nocional	Se debe indicar el monto nocional de la operación, sobre el cual se calculan los intereses. Este campo se debe completar cuando hay un único flujo y el instrumento es distinto de <i>Interest Rate Swap</i> .	Num(15,5)	No
			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.	Char(7)	No
			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.	Char(7)	No
			37	Tasa de interés fija a recibir	Tasa fija a recibir por la Contraparte 1. Este campo se debe completar solo para instrumentos distintos de <i>Interest Rate Swap</i> y que consideran un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contrario se debe indicar la tasa de interés fija a recibir en el campo 61 para cada flujo del calendario de flujo. Para el caso de una Opción, este campo corresponde a la Tasa de interés <i>Strike</i> .	Num(4,10)	Si, solo si el instrumento es SWP o el tipo de tasa de interés a recibir es variable.
			38	Tasa de interés fija a entregar	Tasa fija a entregar por la Contraparte 1. Este campo se debe completar solo para instrumentos distintos de <i>Interest Rate Swap</i> y que consideran un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contrario se debe indicar la tasa de interés fija a recibir en el campo 70 para cada flujo del calendario de flujo. Para el caso de una Opción, este campo corresponde a la Tasa de interés <i>Strike</i> .	Num(4,10)	Si, solo si el instrumento es SWP o el tipo de tasa de interés a entregar es variable.
			39	Spread sobre tasa de interés variable a recibir	Spread sobre la tasa variable que recibe la Contraparte 1. Este campo se debe completar solo para instrumentos distintos de <i>Interest Rate Swap</i> y que consideren un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contrario se debe indicar el spread en el campo 60 para cada flujo del calendario de flujos.	Num(4,10)	Si, solo si el instrumento es SWP o el tipo de tasa de interés a recibir es fija.
			40	Spread sobre tasa de interés variable a entregar	Spread sobre la tasa variable que entrega la Contraparte 1. Este campo se debe completar solo para instrumentos distintos de <i>Interest Rate Swap</i> y que consideren un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contrario se debe indicar el spread en el campo 69 para cada flujo del calendario de flujos.	Num(4,10)	Si, solo si el instrumento es SWP o el tipo de tasa de interés a entregar es fija.

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			44	Precio barrera de entrada ( <i>Knock-in</i> )	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual una opción podrá ser ejercida. Debe ser informado cuando la operación corresponda a una opción con barrera del tipo "up-and-in" o "down-and-in". 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	Num(15,5)	Si
			45	Precio barrera de salida ( <i>Knock-out</i> )	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción no podrá ser ejercida. Debe ser informado cuando la operación corresponda a una opción con barrera del tipo "up-and-out" o "down-and-out". 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.	Num(15,5)	Si
<b>1.B. Calendario de Flujos</b>							
	<b>04</b>			<b>Tipo de registro</b>		Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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	Varchar(52)	No
		SI	31	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.	Datetime	No
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	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). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?	
			58,67	Número del flujo	Correlativo del número del flujo a recibir/entregar a futuro por la Contraparte 1, ya sea por intercambio del principal o pago de intereses.	Num(4)	No	
				Tipo de flujo (E: entrega; R: recibido)	Código del tipo de flujo que se está reportando. E: entrega - R: recibido	Char(1)	No	
			59, 68	Factor sobre Tasa de Interés Variable	Factor que multiplica la tasa variable que recibe/entrega la Contraparte 1.	Num(4,3)	Si	
			60, 69	Spread sobre tasa de interés variable	Spread que recibe/entrega la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable	Num(4,10)	Si, cuando el tipo de tasa de interés que aplica al flujo	
			61, 70	Tasa de interés fija	Tasa de interés fija a recibir/entregar por la Contraparte 1.	Num(4,10)	Si, cuando el tipo de tasa de interés que aplica al flujo	
			62, 71	Fecha de <i>fixing</i> para tasa de interés	Fecha que se considera para la tasa de interés variable de referencia utilizada en el cálculo de intereses del flujo a recibir/entregar por la Contraparte 1, según se estipule en el Contrato.	Date	No	
			63, 72	Fecha de inicio del flujo	Fecha de inicio del período durante el cual se devengarán los intereses del flujo a recibir/Entregar por la Contraparte 1.	Date	No	
			64, 73	Fecha de término del flujo	Fecha de término del período durante el cual se devengarán intereses para el flujo que será recibido/entregado por la Contraparte 1.	Date	No	
			65, 74	Monto nocional aplicable al flujo	Monto nocional que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a recibir/entregar por la Contraparte 1.	Num(15,5)	No	
			66, 75	Monto flujo como intercambio del capital	Monto recibido/entregado por la Contraparte 1 en el flujo respectivo, producto del intercambio de capital o principal.	Num(15,5)	Si	
<b>2. Pagos del Periodo</b>								
	05			Tipo de registro			Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No	

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	31	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.	Datetime	No
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	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). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			77	Correlativo de registro de pago	Correlativo del registro de pago a informar.	Num(5)	No
				Pago recibido/entregado (R/E)	Código del tipo de pago que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			78	Fecha de pago	Fecha de pago o liquidación. En el caso de informar más de un pago como registro agrupado, indicar la fecha correspondiente al pago más reciente.	Date	No
			79,80	Monto pago (recibido/entregado)	Monto recibido/entregado por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. 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.	Num(15,5)	No
			81	Tipo de pago efectuado	Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado.	Char(1)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
<b>3. Garantías</b>							
	<b>06</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	31	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.	Datetime	No
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	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). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			82	Moneda de valorización de la garantía	Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217. 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.	Char(3)	No
			83, 87	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida/entregada	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas que respaldan el Contrato de derivado. 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. 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.	Varchar(52)	No



Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			85, 89	Monto umbral ("Threshold") recibido/entregado	Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 2 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de recouping. Este monto debe estar expresado en la misma moneda en la cual será informado el Valor de Mercado de la operación (Sección 4). En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a	Num(15,5)	Si
			86, 90	Valor garantía (recibida/entregada)	Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas, vigentes al cierre de mes, 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. 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.	Num(15,5)	No
	<b>07</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	31	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.	Datetime	No
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	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). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			83, 87	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida/entregada	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas que respaldan el Contrato de derivado. 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. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la	Varchar(52)	No
			84;88	Tipo activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(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. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a	Char(4)	No
			84,88	Porcentaje tipo de activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(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. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a	Num(3)	No
<b>4. Valor de Mercado</b>							
	08				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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	Varchar(52)	No
		SI	31	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.	Datetime	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	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). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			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.	Char(1)	No
			92	Moneda de valorización	Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217	Char(3)	No
			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. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen. 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.	Num(15,5)	No
			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.	Num(4,10)	Si
			95	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: $\Delta = \frac{\partial V}{\partial S}$ ).	Num(4,10)	Si
			96	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: $\Gamma = \frac{\partial \Delta}{\partial S} = \frac{\partial^2 V}{\partial S^2}$ ).	Num(4,10)	Si
			97	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: $v = \frac{\partial V}{\partial \sigma}$ ).	Num(4,10)	Si

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			98	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. En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones respecto de la Contraparte 2, o un grupo de contrapartes, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)	Si
			99	Ajuste a la valorización por <i>BID-OFFER Spread</i>	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por <i>BID-OFFER Spread</i> de la cartera de contratos de derivados de tasas de interés, para la Contraparte 1. 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.	Num(15,5)	Si
			100	Otros ajustes a la valorización	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. 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.	Num(15,5)	Si

## ANEXO 2.C: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío
<b>1.A. Información general</b>							
	01	SI			<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
			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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	32	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.	Datetime (largo 19)	No
			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 I y IX del CNCI, o en la normativa cambiaria sobre operaciones con instrumentos derivados, que en el futuro pueda modificar o sustituir dicha regulación, según Tabla Naturaleza de la Operación.	Char(1)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío
			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>2.1 Suscripción  2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante.  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>2.2 Modificación  Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante.  2.2.1 Recouponing: Modificación de las condiciones financieras de un Contrato a consecuencia de pagos que hacen las partes con el objeto de modificar su valor razonable (mark to market).  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.  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.  2.2.4 Corrección de reporte: Rectificación de información enviada previamente por el Participante que no corresponda a una modificación contractual.</p> <p>2.3 Término  Corresponde al evento de terminación o pérdida de vigencia de una operación reportada previamente por el Participante, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.  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.  2.3.2 Cesión: Transferencia a un tercero de un Contrato previamente reportado por el Participante (cedente).</p>	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
					<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>2.4 Vigencia 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>		
			4	LEI Contraparte 1	Código LEI (Legal Entity Identifier) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas, si lo tuviere.	Char(20)	Si
			5	RUT Contraparte del Participante (Contraparte 2)	RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar.	Varchar(9)	Si, solo si contraparte 2 es extranjera.
			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.	Char(20)	Si, solo si contraparte 2 es local.
			7	Nombre o Razón Social Contraparte 2	Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.	Varchar(150)	No
			8	País Contraparte 2	Código del país de residencia o domicilio de la Contraparte 2, de acuerdo con la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)	No
			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.	Varchar(9)	Si, solo si garantías es distinto de CC.
			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.	Char(20)	Si, solo si garantías es distinto de CC.

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			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.	Varchar(9)	Si
			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.	Char(20)	Si
			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.	Varchar(9)	Si
			14	LEI Agente de Cálculo	Código LEI (Legal Entity Identifier), si lo tuviere, asignado a la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato	Char(20)	Si
			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.	Varchar(150)	Si
			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. Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.	Varchar(9)	Si, solo si evento de reporte es distinto de CES y ACS,
			17	LEI Cedente o Cesionario	Código LEI (Legal Entity Identifier), 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. Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.	Char(20)	Si, solo si evento de reporte es distinto de CES y ACS,



Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			49	Plataforma de Negociación	Código de la Plataforma de Negociación en la cual fue pactado el contrato de derivado, según código MIC (Market Identifier Code) de la norma ISO 10383. En el caso que el contrato fuese negociado fuera de Bolsa, se deberá indicar en este campo el código "OTC".	Char(4)	No
			50	RUT Intermediario	RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario ( <i>Broker</i> ) que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Varchar(9)	Si
			51	LEI Intermediario	Código LEI (Legal Entity Identifier), si lo tuviere, del Broker que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Char(20)	Si
	<b>02</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	32	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.	Datetime	No
			25	Instrumento	Tipo de instrumento al que corresponde la operación informada, según la Tabla de Instrumentos.	Char(3)	No
			19	Identificador del contrato para agente autorizado	Código único asignado por el Agente Autorizado a cada Contrato suscrito por el Participante. Este campo puede ser informado solo cuando el envío de información al SIID sea realizado por un Agente Autorizado a nombre del Participante.	Varchar(52)	Si
			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.	Char(2)	Si, solo si el instrumento no es una opción.
			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.	Char(4)	Si, solo si el instrumento no es una opción.
			28	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	Char(2)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			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.	Char(3)	Si, solo si modalidad de
			33	Fecha de inicio	Fecha en la cual comienzan a devengarse los intereses de la operación en favor de alguna de las contrapartes.	Date	No
			34	Fecha <i>fixing</i> 1	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.	Date	No
			35	Fecha de término	Fecha en la cual vence o madura la operación de acuerdo con 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".	Date	No
			36	Fecha de pago de la operación	Fecha de la última liquidación de la operación.	Date	Si, solo si modalidad de liquidación es EF.
			37	Fecha de inicio de la Modificación	Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una Modificación.	Date	Si, solo cuando el evento de reporte no es una modificación.
			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. En el caso de tratarse del evento de reporte correspondiente a la "adquisición por cesión" de un contrato, si el Participante (Contraparte 1) ha entregado o recibido un pago debe indicar la moneda de este. Se debe indicar el código de la moneda según norma 4217.	Char(3)	Si
			39	Monto prima/pago inicial recibida(o)	Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos en caso de tratarse de la "adquisición por cesión".	Num(15,5)	Si
			40	Monto prima/pago inicial entregada(o)	Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los en caso de tratarse de la "adquisición por cesión".	Num(15,5)	Si
			41	Objetivo de la operación	Indicar el objetivo de la operación para la Contraparte 1, según lo indicado en la Tabla Objetivo de la Operación. 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.	Char(3)	No
			42	Convenio Marco	Este campo permite un máximo de 25 caracteres, de los cuales los primeros cuatro caracteres corresponden al convenio marco definido en la Tabla Convenio Marco y en los restantes caracteres se debe indicar el número o código único asignado al Convenio Marco de contratación de derivados.	Char(25)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			43	País Jurisdicción del Contrato	Código del país correspondiente a la legislación y jurisdicción aplicable bajo la cual el Contrato está amparado, de acuerdo con la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)	No
			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.	Char(4)	No
			45	Cláusula de Recouponing	Indicar si la operación considera o no cláusula de Recouponing en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de Recouponing.	Char(1)	No
			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.	Char(3)	No
			47	Fecha de efectiva de término o liquidación anticipada	Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.	Date	Si
			48	Compresión de cartera	Identificar si el nuevo Contrato o el término anticipado de uno previamente informado es resultado o no de una compresión u optimización de cartera.	Char(1)	No
			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. En el caso de agrupar (netear) distintos eventos de pagos, estos deberán corresponder a un mismo tipo de acuerdo con la Tabla de Pago Efectuado.	Num(4)	No (no aplica a archivos diarios).
	<b>03</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	32	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.	Datetime (largo 19)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			30	Moneda monto nocional	Código de la moneda en la que está expresado el monto nocional sobre el cual se calculan los flujos a intercambiar, según norma ISO 4217.	Char(3)	No
			31	Monto nocional	Se debe indicar el monto nocional de la operación.	Num(15,5)	No
			20	Tipo de Identificador del activo de renta fija subyacente	Tipo de identificador del activo de renta fija de acuerdo con lo indicado en la Tabla Tipo de Código de Activo Subyacente. Se debe utilizar de preferencia el código ISIN.	Char(7)	No
			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".	Char(12)	No
			22	Tasa pactada	Tasa pactada a futuro del activo de renta fija. Para el caso de una opción este campo corresponde a la Tasa Strike.	Num(4,10)	Si, solo si precio pactado a futuro fue informado.
			23	Precio Pactado a Futuro	Precio pactado a futuro del activo de renta fija. Para el caso de una opción, este campo corresponde al Precio Strike.	Num(15,5)	Si, solo si precio tasa pactada fue informada.
			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.	Char(4)	No
<b>2. Pagos del Periodo</b>					Los campos del pago están separados en "Recibidos" y "Entregados" en el Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras. Sin embargo, para facilitar la creación de los reportes por parte de los usuarios, estos campos fueron compilados en uno solo y se agregaron el campo de "Pago Recibido/Entregado" los cuales indican si el pago es entregado o recibido.		
	05				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	32	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.	Datetime	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			53	Correlativo de registro de pago	Correlativo del registro de pago a informar.	Num(5)	No
				Pago recibido/entregado (R/E)	Código del tipo de pago que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			54	Fecha de pago	Fecha de pago o liquidación. En el caso de informar más de un pago como registro agrupado, indicar la fecha correspondiente al pago más reciente.	Date	No
			55,56	Monto pago (recibido/entregado)	Monto recibido/entregado por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. 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.	Num(15,5)	No
			57	Tipo de pago efectuado	Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado.	Char(1)	No
	<b>06</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	32	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.	Datetime	No
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			58	Moneda de valorización de la garantía	Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217. 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.	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			59, 63	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida/entregada	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas que respaldan el Contrato de derivado. 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. 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.	Varchar(52)	No
			61, 65	Monto umbral ("Threshold") Recibido/entregado	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). 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.	Num(15,5)	Si
			62, 66	Valor garantía (recibida/entregada)	Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas por la Contraparte 1, vigentes al cierre del mes, 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. 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.	Num(15,5)	No
	<b>07</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	32	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.	Datetime	No
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			59, 63	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida / entregada	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas que respaldan el Contrato de derivado. 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. 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.	Varchar(52)	No
			60;64	Tipo activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(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. 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.	Char(4)	No
			60;64	Porcentaje tipo de activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(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. 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.	Num(3)	No
<b>4. Valor de Mercado</b>							
	<b>08</b>				<b>Tipo de registro</b>	Char(2)	No
		SI	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).	Varchar(9)	No
		SI	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. 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.	Varchar(52)	No
		SI	32	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.	Datetime	No

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			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.	Char(1)	No
			68	Moneda de valorización	Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.	Char(3)	No
			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. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen. 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.	Num(15,5)	No
			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.	Num(4,10)	Si
			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: $\Delta = \partial V / \partial S$ ).	Num(4,10)	Si
			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: $\Gamma = \partial \Delta / \partial S = \partial^2 V / \partial S^2$ ).	Num(4,10)	Si
			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: $v = \partial V / \partial \sigma$ ).	Num(4,10)	Si
			74	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. En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones respecto de la Contraparte 2 o un grupo de contrapartes, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)	Si
			75	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 tasas de interés, para la Contraparte 1. 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.	Num(15,5)	Si



Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			76	Otros ajustes a la valorización	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. 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.	Num(15,5)	Si

