

## CARTA-CIRCULAR

|  |        |
|--|--------|
| Bancos   | N° 670 |
| Filiales bancarias comprendidas en el art. 70 letra a) de la LGB | N° 5   |
| Entidades MCF no bancarias                                       | N° 10  |
| Otras entidades fiscalizadas CMF                                 | N° 6   |
| Otros domiciliados o residentes                                  | N° 6   |
| Agentes Autorizados Cap. III.D.3 CNF                             | N° 5   |

- ANT.: 1. Cartas Circulares, del 12 de marzo de 2020 y del 29 de marzo de 2021, que informan y actualizan Especificaciones Técnicas y Tablas relativas al Reglamento Operativo del Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (RO-SIID).
2. Acuerdo de Consejo N° 2416-01-210819, que modificó los Capítulos III.B.1 y III.D.1 del CNF, en materia de tasas de interés extranjeras de referencia.
3. Acuerdo de Consejo N° 2236-01-190711, sobre aprobación del Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras “Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (SIID)” y su respectivo Reglamento Operativo.

MAT.: Nueva actualización de Especificaciones Técnicas y Tablas relativas al Reglamento Operativo del Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (RO-SIID).

Santiago, 24 de septiembre de 2021

Señor Gerente:

Adjunto a la presente, sírvase encontrar actualización del documento de Especificaciones Técnicas y Tablas relativas al Reglamento Operativo del Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (RO-SIID), el que define y explica la estructura de los archivos para los diferentes Sistemas de Información del SIID, y proporciona las tablas y códigos que deben considerarse para la elaboración de estos, por parte de los Participantes, para dar cumplimiento a lo establecido en el Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras (CNF) y su RO-SIID. La modificación citada se adopta en ejercicio de las facultades conferidas por el Título IV del citado Capítulo III.D.3.

La actualización mencionada contempla nuevos códigos en la Tabla 9 “Tipo de Tasa de interés”, que consideran, entre otros aspectos, las modificaciones recientes dispuestas por Acuerdo N° 2416-01-210819 a los Capítulos III.B.1 y III.D.1 del CNF en materia de tasas de interés extranjeras de referencia, Tabla 12 “Garantías” y Tabla 16 “Tipo de Activos en Garantía Tipos en Garantías”, junto con la incorporación de precisiones respecto de las restricciones sobre campos vacíos que se aplican sobre los archivos a reportar por los Participantes, los que se detallan en los Anexos 2.A, 2.B y 2.C.

Saluda atentamente a usted,



**CARMEN GLORIA ESCOBAR J.**  
Gerente de Información Estadística

Incl.: Especificaciones Técnicas y Tablas relativas al Reglamento Operativo del Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (RO-SIID), se adjunta versión actualizada y con control de cambios, este última solo para fines informativos.



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

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

## REGISTRO DE VERSIONES

| Nº VERSIÓN  | FECHA      | COMENTARIOS  |
|-------------|------------|--|
| 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. |
| Versión 1.2 | 20-09-2021 | Se actualiza Tabla 9 Tipo de Tasa de Interés, Tabla 12 Garantías y Tabla 16 Tipo de Activo en Garantía y se actualizan anexos 2A, 2B y 2C.                     |

## 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 |
|       | ANEXOS.....   | 12 |
|       | ANEXO 1: DETALLE DE TABLAS Y CÓDIGOS DEL SIID-TR .....  | 12 |
|       | Tabla 1: Naturaleza de la Información.....  | 13 |
|       | Tabla 2: Eventos de Reporte.....  | 13 |
|       | Tabla 3: Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente.....   | 13 |
|       | Tabla 4: Instrumentos.....  | 13 |
|       | Tabla 5: Clase de Opción.....   | 14 |
|       | Tabla 6: Tipo de Posición .....   | 14 |
|       | Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente.....   | 14 |
|       | Tabla 8: Modalidad de Liquidación.....  | 14 |
|       | Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés .....  | 15 |
|       | Tabla 10: Objetivo de la Operación .....  | 17 |
|       | Tabla 11: Convenio Marco.....   | 17 |
|       | Tabla 12: Garantías.....  | 17 |
|       | Tabla 13: Cláusula de <i>Recouping</i> .....  | 18 |
|       | Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado .....  | 18 |
|       | Tabla 15: Compresión de Cartera .....   | 18 |
|       | Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía .....   | 18 |
|       | Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado .....  | 19 |
|       | Tabla 18: Método de Valorización.....   | 19 |
|       | ANEXO 2.A: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE MONEDAS.....  | 20 |
|       | ANEXO 2.B: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE TASAS DE INTERÉS .....  | 40 |
|       | ANEXO 2.C: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA.....   | 60 |

## 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:

**XXXXXXXXCCCAAAMDD**

Donde:

|          |  |
|----------|--|
| XXXXXXXX | Corresponde al RUT de la institución reportante en el SIID (sin guión y con dígito verificador). |
| CCC      | Código del reporte según Tabla 1.  |
| AAAMDD   | 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)<br>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.<br>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                    |

## Calendario

|  |            |
|--|------------|
| 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 notional 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 notional 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 notional 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 notional 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;9695005RU7JILXCDF47  
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 Header | 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.<br><br>(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;ld\_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;E;Portafolio\_Id\_1234;BBCH;55  
7;630000009;ld\_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;E;Portafolio\_Id\_1234;BTGR;45  
8;610000002;ld\_000126798;2020-10-01T10:35:47;0;M;USD;147984.2365;;;;;24560;;5650  
8;620000000;ld\_000126472;2020-10-02T09:15:04;0;M;USD;67894.382;;;;;24560;;5650  
8;630000009;ld\_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;M;USD;-672830.451;;;;;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 Recouponsing
- Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado
- Tabla 15: Compresión de Cartera
- Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía
- Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado
- Tabla 18: Método de Valorización

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 |
| <b>Australia</b>   |         |
| AONIA (AUD Overnight Index Average)  | RBACOR  |
| BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a un día  | BBSW1D  |
| BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 30 días   | BBSW1M  |
| BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 60 días   | BBSW2M  |
| BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 90 días   | BBSW3M  |
| BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 120 días  | BBSW4M  |
| BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 150 días  | BBSW5M  |
| BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 180 días  | BBSW6M  |
| BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 360 días  | BBSW1Y  |
| <b>Brasil</b>  |         |
| CDI (Certificado de Depósito Interbancario)  |         |
| <b>Chile</b>   |         |
| 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 |
| <b>Estados Unidos de América</b>   |         |
| <i>Prime Rate</i>  | PRIMERT |
| LIBOR en Dólares de los EE.UU. <i>overnight</i> (ICE)  | US000ON |
| 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 |
| <b>Euro</b>  |         |
| LIBOR en Euros <i>overnight</i> (ICE)  | EE000ON |
| LIBOR en Euros a 7 días (ICE)  | EE0001W |

| Descripción  | Código  |
|--|---------|
| 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 |
| <b>Inglaterra</b>  |         |
| LIBOR en Libras esterlinas <i>overnight</i> (ICE)          | BP0000N |
| 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 |
| <b>Suiza</b>   |         |
| LIBOR en Francos suizos spot <i>next day</i> (ICE)         | SF0000N |
| 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 |
| <b>Japón</b>   |         |
| Libor en Yenes japoneses spot <i>next day</i> (ICE)        | JY0000N |
| 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     |
| Ambas partes constituyen alguna forma de garantía (Margen Inicial o Margen de Variación)           | 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     |
| La contraparte 1 proporciona otras* formas de garantías  | OA     |
| La contraparte 2 proporciona otras* formas de garantías  | OB     |
| Ninguna contraparte constituye garantías   | SC     |
| Contraparte Central  | CC     |

\*Entre otras formas de garantía, se encuentran aquellas líneas de créditos (para uso exclusivo de derivados o para otros fines) que permitirían garantizar el contrato de derivados, en caso del incumplimiento de la contraparte.

Tabla 13: Cláusula de *Recouponing*

| Descripción                        | Código |
|------------------------------------|--------|
| Con cláusula de <i>Recouponing</i> | Y      |
| Sin cláusula de <i>Recouponing</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   |
| Fondos Mutuos nacionales tipo 1* y Fondos del Mercado Monetario o Money Market Funds** internacionales | FMMM   |
| Otros Fondos Mutuos  | FOTR   |
| Bienes Inmuebles   | BSIM   |
| Otras garantías  | OTRO   |

\*Según lo dispuesto en la Circular N°1.578 de 2002 emitida por la Comisión para el Mercado Financiero, la cual establece la clasificación de Fondos Mutuos según su política de inversiones.

\*\* Corresponden a Fondos del Mercado Monetario o Money Market Funds, aquellos fondos que son reconocidos como tales, según los reglamentos y normas emitidos por la autoridad competente del respectivo país de emisión del fondo.

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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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<br/> 2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante.<br/> 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<br/> Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante.<br/> 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).<br/> 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.<br/> 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.<br/> 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<br/> Corresponde al evento de terminación o pérdida de vigencia de una operación reportada previamente por el Participante, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.<br/> 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?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|--|
|             |                  |             |                              |  | <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<br/>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)     | Sí, cuando Contraparte 1 no posee código LEI.  |
|             |                  |             | 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(10)  | Sí, 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)     | Sí, solo cuando la contraparte 2 es local y distinta de un Fondo administrado por una AGF o AFP que pose código LEI. |
|             |                  |             | 7                            | Nombre o razón social contraparte 2              | Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.   | Varchar(150) | No   |



| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo  | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|--|--------------|---|
|             |                  |             | 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 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)   | Sí, el contrato no está bajo una Contraparte Central local.                     |
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte Central local o extranjera. |
|             |                  |             | 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)   | Sí, cuando información no aplica.   |
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando información no aplica.   |
|             |                  |             | 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)   | Sí, cuando el Agente de Cálculo no es local.                                    |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                            | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|---|
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando el Agente de cálculo no posee un LEI   |
|             |                  |             | 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) | No  |
|             |                  |             | 16                           | RUT del Cedente o Cesionario            | RUT (Rol Único Tributario) de la Contraparte domiciliada o residente en Chile que cede (evento suscripción 2.1.2 "Adquisición por Cesión", evento de modificación 2.2.2 "Modificación de Contraparte por Cesión") o a la que se cede (evento término 2.3.2 "Cesión") un Contrato.<br>Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.           | Varchar(9)   | Sí, cuando evento de reporte es distinto de CES y ACS o el Cedente o Cesionario no es local.                |
|             |                  |             | 17                           | LEI Cedente o Cesionario                | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ), si lo tuviere, asignado a la Contraparte que cede (Evento Suscripción 2.1.2 "Adquisición por Cesión", Evento de Modificación 2.2.2 "Modificación de Contraparte por Cesión") o a la que se cede (Evento Término 2.3.2 "Cesión") un Contrato.<br>Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo. | Char(20)     | Sí, cuando el evento de reporte es distinto de CES y ACS, o el Cedente o Cesionario no posee un código LEI. |
|             |                  |             | 56                           | Plataforma de Negociación               | Código de la Plataforma de Negociación en la cual fue pactado el contrato de derivado, según código MIC ( <i>Market Identifier Code</i> ) de la norma ISO 10383.<br>En el caso que el contrato fuese negociado fuera de Bolsa, se deberá indicar en este campo el código "OTC".   | Char(4)      | No  |
|             |                  |             | 57                           | RUT Intermediario                       | RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario ( <i>Broker</i> ) que actuó como intermediario en el cierre de la operación.   | Varchar(9)   | Sí, cuando la información no aplica.  |
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando la información no aplica.  |

| 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>   | 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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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)  | Sí, cuando no aplica                        |
|             |                  |             | 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)      | Sí, 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)      | Sí, 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  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                         | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--------------------------------------|---|--------------|---|
|             |                  |             | 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)      | Sí, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física.   |
|             |                  |             | 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         | Sí, solo si N° de intercambios o flujos es mayor a 1.   |
|             |                  |             | 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.<br>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         | Sí, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1. |
|             |                  |             | 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         | Sí, cuando el evento de reporte no es una modificación.   |
|             |                  |             | 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)      | Sí, solo cuando no se ha informado Monto prima/pago inicial recibida ni Monto prima/pago inicial entregada  |
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando no hay una prima o pago inicial recibido.  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                                   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---|
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando no hay una prima o pago inicial entregado. |
|             |                  |             | 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  |
|             |                  |             | 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 | Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.   | Date         | Sí, cuando el contrato no ha sido anticipado.         |
|             |                  |             | 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  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|------------------------------------|
|             |                  |             | 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.<br>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.<br>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 ( <i>Unique Transaction Identifier</i> ), debe ser indicado en este campo.<br>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).<br>Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--|
|             |                  |             | 24                           | Opciones:<br>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)      | Sí, solo si el instrumento no es una opción sobre un derivado.                             |
|             |                  |             | 27                           | Moneda<br>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<br>Comprada                | Monto de la moneda subyacente a recibir por la Contraparte 1 al término de la operación.  | Num(15,5)    | Sí, solo si instrumento tiene un precio desconocido y Monto Moneda Vendida fue informado.  |
|             |                  |             | 29                           | Moneda<br>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<br>Vendida                 | Monto de la moneda subyacente a entregar por la Contraparte 1 al término de la operación.   | Num(15,5)    | Sí, solo si instrumento tiene un precio desconocido y Monto Moneda Comprada fue informado. |
|             |                  |             | 31                           | Tipo de Tasa<br>de Interés a<br>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.  | Varchar(7)   | Sí, solo si el instrumento no posee intercambio de intereses.                              |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                                  | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--|
|             |                  |             | 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.   | Varchar(7)   | Sí, solo si el instrumento no posee intercambio de intereses.  |
|             |                  |             | 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         | Sí, cuando la liquidación es por entrega física o es por compensación con una única fecha de <i>fixing</i> . |
|             |                  |             | 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.<br>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)    | Sí, cuando el precio pactado es desconocido.   |
|             |                  |             | 42                           | Puntos Forward                                | Diferencia entre el Precio Pactado a Futuro y el Precio Spot considerado en la negociación.   | Num(4,10)    | Sí, 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.<br>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)    | Sí, cuando la información no aplica.   |



| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                                  | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--------------------------------------|
|             |                  |             | 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 "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)    | Sí, cuando la información no aplica. |

| Sub-sección                      | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción  | Formato dato   | ¿Puede venir vacío?                  |
|----------------------------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|----------------|--------------------------------------|
| <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)     | 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.<br>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.<br>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)       | Sí, cuando la información no aplica. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                                 | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---|
|             |                  |             | 62/72                        | Spread sobre tasa de interés variable        | Spread que recibe/entrega la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable  | Num(4,10)    | Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es fija.     |
|             |                  |             | 63/ 73                       | Tasa de interés fija                         | Tasa de interés fija a recibir/entregar por la Contraparte 1.   | Num(4,10)    | Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es variable. |
|             |                  |             | 64/74                        | 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         | Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es fija.     |
|             |                  |             | 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  |
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando no hay intercambio de capital.                   |
|             |                  |             | 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)      | Sí, solo cuando no hay intercambio de capital.              |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---------------------|
|             | 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          | 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                  |
|             |                  |             | 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                  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo   | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                     |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---|
|             | 06               |             |                              | Tipo de registro   | Esta sección se debe completar cuando aplica informar garantías o umbrales.  | 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                                      |
|             |                  |             |                              | 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)      | Sí, cuando no hay garantías a informar. |
|             |                  |             | 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)  | Sí, cuando no hay garantías a informar  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                                  | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                    |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--|
|             |                  |             | 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>recouponing</i> . Este monto debe estar expresado en la misma moneda en la cual será informado el Valor de Mercado de la operación (Sección 4). 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)    | Sí, cuando no hay un umbral pactado    |
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando no hay garantías a informar |
|             | <b>07</b>        |             |                              |   | <b>Tipo de registro</b>   | Char(2)      |  |
|             |                  | 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.<br>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).<br>Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---------------------|
|             |                  |             | 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.<br>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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.   | 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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.   | Num(3)       | No                  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---------------------|
|             | 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.<br>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).<br>Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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.<br>En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen.<br>Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá expresar el valor de mercado en base a las normas sectoriales definidas por el supervisor respectivo. | Num(15,5)    | No                  |



| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo  | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|--|--------------|--------------------------------------|
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 100                          | Opciones: Gamma   | En este campo se informará el cambio que tendría Delta ( $\Delta$ ) si el precio del subyacente (S) varía en +1% respecto de su valor vigente (Gamma: $\Gamma = \partial \Delta / \partial S = \partial^2 V / \partial S^2$ ).   | Num(4,10)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 102                          | Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte ( <i>Credit value adjustment</i> ) | Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2.<br>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)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.   | Num(15,5)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.                | Num(15,5)    | Sí, cuando la información no aplica. |

## 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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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</p> <p>2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante.</p> <p>2.1.2 Adquisición por cesión: Cuando el Participante asume las obligaciones y es cesionario de los derechos vinculados a un Contrato suscrito anteriormente por un tercero. 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.</p> <p>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).</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: 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 compración 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<br/>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)     | Sí, cuando Contraparte 1 no posee código LEI   |
|             |                  |             | 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(10)  | Sí, 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)     | Sí, solo si la contraparte 2 es local y distinta de un Fondo administrado por una AGF o AFP que posee código LEI |
|             |                  |             | 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)   | Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo  | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|---|
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte Central local o extranjera.     |
|             |                  |             | 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)   | Sí, cuando información no aplica.   |
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando información no aplica.   |
|             |                  |             | 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)   | Sí, cuando el Agente de Cálculo no es local   |
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando el Agente de cálculo no posee un LEI                                     |
|             |                  |             | 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) | No  |
|             |                  |             | 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)   | Sí, cuando evento de reporte es distinto de CES y ACS, o el Cedente o Cesionario no |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo              | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------|--|--------------|---|
|             |                  |             |                              |                           |  |              | posee un código LEI.  |
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando evento de reporte es distinto de CES y ACS o el Cedente o Cesionario no posee un código LEI. |
|             |                  |             | 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)   | Sí, cuando la información no aplica.  |
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando la información no aplica.  |

| 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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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.<br>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)    | Sí, cuando no aplica.                        |
|             |                  |             | 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)        | Sí, 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)        | Sí, 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   |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                       | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|------------------------------------|--|--------------|--|
|             |                  |             | 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)      | Sí, solo si modalidad de liquidación es entrega física.  |
|             |                  |             | 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 consideran 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         | Sí, solo si el instrumento es SWP o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1.   |
|             |                  |             | 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 <i>fixing</i> para cada uno de los flujos en la sección de calendario de flujos.  | Date         | Sí, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física, el instrumento es SWP o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1. |
|             |                  |             | 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         | Sí, 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?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|--|--------------|--|
|             |                  |             | 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)      | Sí, solo cuando no se ha informado Monto prima/pago inicial recibida ni Monto prima/pago inicial entregada |
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando no hay una prima o pago inicial recibido.   |
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando no hay una prima o pago inicial entregado.  |
|             |                  |             | 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   |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                                       | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                           |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---|
|             |                  |             | 52                           | Fecha efectiva de término o liquidación anticipada | Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.  | Date         | Sí, cuando el contrato no ha sido anticipado. |
|             |                  |             | 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.<br><br>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  |
|             |                  |             | 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.<br>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.<br><br>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.<br>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).<br>Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.   | Num(2)       | No  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                        | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|-------------------------------------|--|--------------|---|
|             |                  |             | 24                           | Opciones:<br>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)      | Sí, solo si el instrumento no es una opción sobre un derivado.  |
|             |                  |             | 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  |
|             |                  |             | 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)    | Si, solo si instrumento es SWP o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1.   |
|             |                  |             | 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.   | Varchar(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.  | Varchar(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 Interest Rate Swap y que consideran un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contario se debe indicar la tasa de interés fija a recibir en el campo 61 para cada flujo del calendario de flujo.<br>Para el caso de una Opción, este campo corresponde a la Tasa de interés Strike.  | Num(4,10)    | Si, solo si el instrumento es SWP, el N° de intercambios o flujos es mayor a 1 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 Interest Rate Swap y que consideran un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contario se debe indicar la tasa de interés fija a recibir en el campo 70 para cada flujo del calendario de flujo.<br>Para el caso de una Opción, este campo corresponde a la Tasa de interés Strike. | Num(4,10)    | Si, solo si el instrumento es SWP, el N° de intercambios o flujos es mayor a 1 o el tipo de tasa de interés a entregar es variable. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                                     | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---|
|             |                  |             | 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 Interest Rate Swap 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, el N° de intercambios o flujos es mayor a 1 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 Interest Rate Swap 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, el N° de intercambios o flujos es mayor a 1 o el tipo de tasa de interés a entregar es fija. |
|             |                  |             | 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 entrada).     | Num(15,5)    | Sí, cuando la información no aplica.  |
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando la información o aplica.   |

| Sub-sección                      | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                 |
|----------------------------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|-------------------------------------|
| <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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0). | Num(2)       | No                                  |
|                                  |                  |             | 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)     | Sí, cuando la información no aplica |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                                | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|---|
|             |                  |             | 60, 69                       | Spread sobre tasa de interés variable       | Spread que recibe/entrega la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable  | Num(4,10)    | Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es fija.     |
|             |                  |             | 61, 70                       | Tasa de interés fija                        | Tasa de interés fija a recibir/entregar por la Contraparte 1.   | Num(4,10)    | Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es variable. |
|             |                  |             | 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         | Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es fija.     |
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando no hay intercambio de capital.                   |

| Sub-sección                 | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-----------------------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---------------------|
| <b>2. Pagos del Periodo</b> |                  |             |                              |  |   |              |                     |
|                             | 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          | 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                  |
|                             |                  |             | 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 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                  |
|                             |                  |             | 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>  | <b>Esta sección se debe completar cuando aplica informar garantías o umbrales.</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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.   | Char(3)      | Sí, cuando no hay garantías a informar. |
|                     |                  |             | 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.<br>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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. | Varchar(52)  | Sí, cuando no hay garantías a informar. |



| 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 la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.   | Num(15,5)    | Sí, cuando no hay un umbral pactado.    |
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando no hay garantías a informar. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo   | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---------------------|
|             | <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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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                  |
|             |                  |             | 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.<br>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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. | Varchar(52)  | No                  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                          | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|---|--------------|---------------------|
|             |                  |             | 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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. | 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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. | Num(3)       | No                  |

| Sub-sección                | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|----------------------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---------------------|
| <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.<br>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).<br>Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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.<br>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                  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo   | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|--------------------------------------|
|             |                  |             | 94                           | Opciones:<br>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)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 95                           | Opciones:<br>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)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 96                           | Opciones:<br>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)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 97                           | Opciones:<br>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)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 98                           | Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte<br>( <i>Credit value adjustment</i> ) | Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2.<br>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)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.                                    | Num(15,5)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.       | Num(15,5)    | Sí, cuando la información no aplica. |

## 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.<br>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</p> <p>2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante.</p> <p>2.1.2 Adquisición por cesión: Cuando el Participante asume las obligaciones y es cesionario de los derechos vinculados a un Contrato suscrito anteriormente por un tercero.</p> <p>2.2 Modificación</p> <p>Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante.</p> <p>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).</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: 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> | 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<br/>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)     | Sí, cuando Contraparte 1 no posee código LEI.   |
|             |                  |             | 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(10)  | Sí, 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)     | Sí, solo cuando la contraparte 2 es local, y distinta de un Fondo administrado por una AGF o AFP que pose código LEI. |
|             |                  |             | 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)   | Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte Central local.              |
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte Central local o extranjera. |
|             |                  |             | 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)   | Sí, cuando información no aplica.   |
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando información no aplica.   |
|             |                  |             | 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)   | Sí, cuando el Agente de Cálculo no es local.                                    |
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando el Agente de cálculo no posee  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                            | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|--|--------------|--|
|             |                  |             |                              |   |  |              | un LEI   |
|             |                  |             | 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) | No   |
|             |                  |             | 16                           | RUT del Cedente o Cesionario            | RUT (Rol Único Tributario) de la Contraparte domiciliada o residente en Chile que cede (evento suscripción 2.1.2 "Adquisición por Cesión", evento de modificación 2.2.2 "Modificación de Contraparte por Cesión") o a la que se cede (evento término 2.3.2 "Cesión") un Contrato.<br>Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.  | Varchar(9)   | Sí, cuando el evento de reporte es distinto de CES y ACS o el Cedente o Cesionario no es local.            |
|             |                  |             | 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.<br>Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo. | Char(20)     | Sí, cuando el evento de reporte es distinto de CES y ACS o el Cedente o Cesionario no posee un código LEI. |
|             |                  |             | 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.<br>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)   | Sí, cuando la información no aplica.   |
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando la información no aplica.   |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                                      | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|---|
|             | 02               |             |                              |   | <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.<br>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.<br>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)  | Sí, cuando no aplica  |
|             |                  |             | 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)      | Sí, cuando 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)      | Sí, cuando 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  |
|             |                  |             | 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)      | Sí, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física. |
|             |                  |             | 33                           | Fecha de inicio                                   | Fecha en la cual comienzan a devengarse los intereses de la operación en favor de alguna de las contrapartes.   | Date         | Sí, solo si N° de intercambios o flujos es mayor a 1.         |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                          | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|--|--------------|---|
|             |                  |             | 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         | Si, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1. |
|             |                  |             | 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         | No  |
|             |                  |             | 37                           | Fecha de inicio de la Modificación    | Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una Modificación.   | Date         | Sí, 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, solo cuando no se ha informado Monto prima/pago inicial recibida ni Monto prima/pago inicial entregada  |
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando no hay una prima o pago inicial recibido.  |
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando no hay una prima o pago inicial entregado.   |
|             |                  |             | 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  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                                       | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                           |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---|
|             |                  |             | 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  |
|             |                  |             | 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 efectiva de término o liquidación anticipada | Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.   | Date         | Sí, cuando el contrato no ha sido anticipado. |
|             |                  |             | 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.<br>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).            |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                              | Descripción   | Formato dato        | ¿Puede venir vacío?                                   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|---------------------|---|
|             | 03               |             |                              |   | <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.<br>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  |
|             |                  |             | 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 | 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)           | Sí, solo si el 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)           | Sí, solo si la 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  |

| Sub-sección                 | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                             | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-----------------------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---------------------|
| <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 agregó 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.<br>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                  |
|                             |                  |             | 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.<br>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.<br>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                  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo   | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                     |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---|
|             | 06               |             |                              | <b>Tipo de registro</b>  | <b>Esta sección se debe completar cuando aplica informar garantías o umbrales.</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.<br>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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.  | Char(3)      | Sí, cuando no hay garantías a informar. |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. | Varchar(52)  | Sí, cuando no hay garantías a informar. |
|             |                  |             | 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).<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.   | Num(15,5)    | Sí, cuando no hay un umbral pactado     |
|             |                  |             | 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").<br>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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.                 | Num(15,5)    | Sí, cuando no hay garantías a informar. |



| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo   | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---------------------|
|             | <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.<br>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                  |
|             |                  |             | 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.<br>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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. | 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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.  | 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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.  | Num(3)       | No                  |

| Sub-sección                | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                             | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                  |
|----------------------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|--------------------------------------|
| <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                                   |
|                            |                  |             | 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)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|                            |                  |             | 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)    | Sí, cuando la información no aplica. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo   | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|--------------------------------------|
|             |                  |             | 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: $\Gamma = \partial\Delta/\partial S = \partial^2V/\partial S^2$ ).  | Num(4,10)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 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)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 74                           | Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte (Credit value adjustment) | Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2.<br>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)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.  | Num(15,5)    | Sí, cuando la información no aplica. |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.      | Num(15,5)    | Sí, cuando la información no aplica. |





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

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

## REGISTRO DE VERSIONES

| Nº VERSIÓN  | FECHA                      | COMENTARIOS  |
|-------------|----------------------------|--|
| 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. |
| Versión 1.2 | <a href="#">20-09-2021</a> | <a href="#">Se actualiza Tabla 9 Tipo de Tasa de Interés, Tabla 12 Garantías y Tabla 16 Tipo de Activo en Garantía y se actualizan anexos 2A, 2B y 2C.</a>     |

## 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 |
|       | ANEXOS.....   | 12 |
|       | ANEXO 1: DETALLE DE TABLAS Y CÓDIGOS DEL SIID-TR .....  | 12 |
|       | Tabla 1: Naturaleza de la Información.....  | 13 |
|       | Tabla 2: Eventos de Reporte.....  | 13 |
|       | Tabla 3: Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente.....   | 13 |
|       | Tabla 4: Instrumentos.....  | 13 |
|       | Tabla 5: Clase de Opción.....   | 14 |
|       | Tabla 6: Tipo de Posición .....   | 14 |
|       | Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente.....   | 14 |
|       | Tabla 8: Modalidad de Liquidación.....  | 14 |
|       | Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés .....  | 15 |
|       | Tabla 10: Objetivo de la Operación .....  | 17 |
|       | Tabla 11: Convenio Marco.....   | 17 |
|       | Tabla 12: Garantías.....  | 17 |
|       | Tabla 13: Cláusula de <i>Recouping</i> .....  | 18 |
|       | Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado .....  | 18 |
|       | Tabla 15: Compresión de Cartera .....   | 18 |
|       | Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía .....   | 18 |
|       | Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado .....  | 19 |
|       | Tabla 18: Método de Valorización.....   | 19 |
|       | ANEXO 2.A: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE MONEDAS.....  | 20 |
|       | ANEXO 2.B: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE TASAS DE INTERÉS .....  | 40 |
|       | ANEXO 2.C: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA.....   | 60 |

## 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:

**XXXXXXXXCCCAAAMDD**

Donde:

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

CCC              Código del reporte según Tabla 1.

AAAMDD        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)<br>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.<br>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                    |

## Calendario

|  |            |
|--|------------|
| 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 Header | 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.<br><br>(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;ld\_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;E;Portafolio\_Id\_1234;BBCH;55  
7;630000009;ld\_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;E;Portafolio\_Id\_1234;BTGR;45  
8;610000002;ld\_000126798;2020-10-01T10:35:47;0;M;USD;147984.2365;;;;;24560;;5650  
8;620000000;ld\_000126472;2020-10-02T09:15:04;0;M;USD;67894.382;;;;;24560;;5650  
8;630000009;ld\_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;M;USD;-672830.451;;;;;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 Recouponsing
- Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado
- Tabla 15: Compresión de Cartera
- Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía
- Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado
- Tabla 18: Método de Valorización



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         |
|--|----------------|
| <u>Tasa fija</u>   | <u>FIXEDRT</u> |
| <b>Australia</b>   |                |
| <u>AONIA (AUD Overnight Index Average)</u>   | <u>RBACOR</u>  |
| <u>BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a un día</u>   | <u>BBSW1D</u>  |
| <u>BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 30 días</u>  | <u>BBSW1M</u>  |
| <u>BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 60 días</u>  | <u>BBSW2M</u>  |
| <u>BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 90 días</u>  | <u>BBSW3M</u>  |
| <u>BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 120 días</u>   | <u>BBSW4M</u>  |
| <u>BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 150 días</u>   | <u>BBSW5M</u>  |
| <u>BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 180 días</u>   | <u>BBSW6M</u>  |
| <u>BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 360 días</u>   | <u>BBSW1Y</u>  |
| <b>Brasil</b>  |                |
| <u>CDI (Certificado de Depósito Interbancario)</u>   |                |
| <b>Chile</b>   |                |
| <u>Tasa fija</u>   | <u>FIXEDRT</u> |
| 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        |
| <b>Estados Unidos de América</b>   |                |
| <i>Prime Rate</i>  | PRIMERT        |
| LIBOR en Dólares de los EE.UU. <i>overnight</i> (ICE)  | US000ON        |
| 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        |
| <b>Euro</b>  |                |
| LIBOR en Euros <i>overnight</i> (ICE)  | EE000ON        |

| Descripción  | Código  |
|--|---------|
| 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 |
| <b>Inglaterra</b>  |         |
| 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 |
| <b>Suiza</b>   |         |
| LIBOR en Francos suizos <i>spot next day</i> (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 |
| <b>Japón</b>   |         |
| Libor en Yenes japoneses <i>spot 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        |
| <u>Ambas partes constituyen alguna forma de garantía (Margen Inicial o Margen de Variación)</u><br><u>Parcialmente caucionado o garantizado: Solo el Margen de Variación será constituido por alguna de las partes</u> | 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        |
| <u>La contraparte 1 proporciona otras* formas de garantías</u>   | <u>OA</u> |
| <u>La contraparte 2 proporciona otras* formas de garantías</u>   | <u>OB</u> |
| Ninguna contraparte constituye garantías   | SC        |
| Contraparte Central  | CC        |

\*Entre otras formas de garantía, se encuentran aquellas líneas de créditos (para uso exclusivo de derivados o para otros fines) que permitirían garantizar el contrato de derivados, en caso del incumplimiento de la contraparte.

Tabla 13: Cláusula de *Recouponing*

| Descripción                        | Código |
|------------------------------------|--------|
| Con cláusula de <i>Recouponing</i> | Y      |
| Sin cláusula de <i>Recouponing</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        |
| <u>Fondos Mutuos nacionales tipo 1* y Fondos del Mercado Monetario o Money Market Funds** internacionales</u> | <u>FMMM</u> |
| <u>Otros Fondos Mutuos</u>  | <u>FOTR</u> |
| Bienes Inmuebles  | BSIM        |
| Otras garantías   | OTRO        |

\*Según lo dispuesto en la Circular N°1.578 de 2002 emitida por la Comisión para el Mercado Financiero, la cual establece la clasificación de Fondos Mutuos según su política de inversiones.

\*\* Corresponden a Fondos del Mercado Monetario o Money Market Funds, aquellos fondos que son reconocidos como tales, según los reglamentos y normas emitidos por la autoridad competente del respectivo país de emisión del fondo.

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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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<br/> 2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante.<br/> 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<br/> Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante.<br/> 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).<br/> 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.<br/> 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.<br/> 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<br/> Corresponde al evento de terminación o pérdida de vigencia de una operación reportada previamente por el Participante, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.<br/> 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?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---|
|             |                  |             |                              |  | <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<br/>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)     | <u>Sí, cuando Contraparte 1 no posee código LEI.</u>  |
|             |                  |             | 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(109) | Sí, 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)     | Sí, solo cuando la contraparte 2 es <u>local y distinta de un Fondo administrado por una AGF o AFP que pose código LEI.</u> |
|             |                  |             | 7                            | Nombre o razón social contraparte 2              | Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.   | Varchar(150) | No  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo  | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|--|--------------|--|
|             |                  |             | 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 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)   | Sí, <u>el contrato no está bajo una Contraparte Central local.</u>                     |
|             |                  |             | 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)     | Sí, cuando <u>el contrato no está bajo una Contraparte Central local o extranjera.</u> |
|             |                  |             | 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)   | Sí, <u>cuando información no aplica.</u>   |
|             |                  |             | 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)     | Sí, <u>cuando información no aplica.</u>   |
|             |                  |             | 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)   | Sí, <u>cuando el Agente de Cálculo no es local.</u>                                    |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                            | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--|
|             |                  |             | 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)     | Sí, <u>cuando el Agente de cálculo no posee un LEI</u>   |
|             |                  |             | 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) | No <del>Si</del>   |
|             |                  |             | 16                           | RUT del Cedente o Cesionario            | RUT (Rol Único Tributario) de la Contraparte domiciliada o residente en Chile que cede (evento suscripción 2.1.2 "Adquisición por Cesión", evento de modificación 2.2.2 "Modificación de Contraparte por Cesión") o a la que se cede (evento término 2.3.2 "Cesión") un Contrato.<br>Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.           | Varchar(9)   | Sí, cuando evento de reporte es distinto de CES y ACS o el <u>Cedente o Cesionario no es local.</u>                |
|             |                  |             | 17                           | LEI Cedente o Cesionario                | Código LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> ), si lo tuviere, asignado a la Contraparte que cede (Evento Suscripción 2.1.2 "Adquisición por Cesión", Evento de Modificación 2.2.2 "Modificación de Contraparte por Cesión") o a la que se cede (Evento Término 2.3.2 "Cesión") un Contrato.<br>Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo. | Char(20)     | Sí, cuando el evento de reporte es distinto de CES y ACS, o el <u>Cedente o Cesionario no posee un código LEI.</u> |
|             |                  |             | 56                           | Plataforma de Negociación               | Código de la Plataforma de Negociación en la cual fue pactado el contrato de derivado, según código MIC ( <i>Market Identifier Code</i> ) de la norma ISO 10383.<br>En el caso que el contrato fuese negociado fuera de Bolsa, se deberá indicar en este campo el código "OTC".   | Char(4)      | No   |
|             |                  |             | 57                           | RUT Intermediario                       | RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario ( <i>Broker</i> ) que actuó como intermediario en el cierre de la operación.   | Varchar(9)   | Sí, <u>cuando la información no aplica.</u>  |
|             |                  |             | 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)     | Sí, <u>cuando la información no aplica.</u>  |

| 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>   | 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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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)  | Sí, <u>cuando no aplica</u>                 |
|             |                  |             | 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)      | Sí, 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)      | Sí, 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  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                         | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--------------------------------------|--|--------------|--|
|             |                  |             | 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)      | Sí, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física.  |
|             |                  |             | 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         | <u>Sí, solo si N° de intercambios o flujos es mayor a 1.</u>   |
|             |                  |             | 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         | Sí, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física <u>o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1.</u> |
|             |                  |             | 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         | Sí, cuando el evento de reporte no es una modificación.  |
|             |                  |             | 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)      | <u>Sí, solo cuando no se ha informado Monto prima/pago inicial recibida ni Monto prima/pago inicial entregada</u>  |
|             |                  |             | 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)    | <u>Sí, cuando no hay una prima o pago inicial recibido.</u>  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|--|
|             |                  |             | 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)    | Sí, <u>cuando no hay una prima o pago inicial entregado.</u> |
|             |                  |             | 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   |
|             |                  |             | 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 | Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.   | Date         | Sí, <u>cuando el contrato no ha sido anticipado.</u>         |
|             |                  |             | 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   |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|------------------------------------|
|             |                  |             | 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.<br>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.<br>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 ( <i>Unique Transaction Identifier</i> ), debe ser indicado en este campo.<br>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).<br>Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|-------------------------------------|---|--------------|---|
|             |                  |             | 24                           | Opciones:<br>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)      | Sí, solo si el instrumento no es una opción <u>sobre un derivado.</u>                             |
|             |                  |             | 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)    | <u>Sí, solo si instrumento tiene un precio desconocido y Monto Moneda Vendida fue informado.</u>  |
|             |                  |             | 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)    | <u>Sí, solo si instrumento tiene un precio desconocido y Monto Moneda Comprada fue informado.</u> |
|             |                  |             | 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.  | VarChar(7)   | Sí, solo si el instrumento <u>no posee intercambio de intereses.</u>                              |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                                 | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|--|
|             |                  |             | 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.   | VarChar(7)   | Sí, solo si el instrumento no posee intercambio de intereses..                                       |
|             |                  |             | 36                           | Fecha fixing 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         | Sí, cuando la liquidación es por entrega física o es por compensación con una única fecha de fixing. |
|             |                  |             | 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.<br>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)    | Sí, cuando el precio pactado es desconocido.   |
|             |                  |             | 42                           | Puntos Forward                               | Diferencia entre el Precio Pactado a Futuro y el Precio Spot considerado en la negociación.   | Num(4,10)    | Sí, para instrumentos distintos de FWD.  |
|             |                  |             | 46                           | Precio barrera de entrada (Knock-in)         | Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción podrá ser ejercida.<br>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 entrada). | Num(15,5)    | Sí, cuando la información no aplica.   |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                         | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                        |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--------------------------------------|---|--------------|--|
|             |                  |             | 47                           | Precio barrera de salida (Knock-out) | 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)    | <u>Sí, cuando la información o aplica.</u> |

| Sub-sección                      | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción  | Formato dato   | ¿Puede venir vacío?                         |
|----------------------------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|----------------|---|
| <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)     | 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.<br>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.<br>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)       | Sí, <u>cuando la información no aplica.</u> |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                                 | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|--|
|             |                  |             | 62/72                        | Spread sobre tasa de interés variable        | Spread que recibe/entrega la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable  | Num(4,10)    | Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo <u>es fija</u> .    |
|             |                  |             | 63/ 73                       | Tasa de interés fija                         | Tasa de interés fija a recibir/entregar por la Contraparte 1.   | Num(4,10)    | Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al fujo <u>es variable</u> . |
|             |                  |             | 64/74                        | 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         | Sí, <u>cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es fija</u> .    |
|             |                  |             | 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   |
|             |                  |             | 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)    | Sí, <u>cuando no hay intercambio de capital</u> .                  |
|             |                  |             | 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)      | Sí, <u>solo cuando no hay- intercambio de capital</u> .            |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---------------------|
|             | 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          | 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                  |
|             |                  |             | 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                  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo   | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                            |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|--|
|             | 06               |             |                              | Tipo de registro   | <u>Esta sección se debe completar cuando aplica informar garantías o umbrales.</u>   | 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   |
|             |                  |             |                              | 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)      | Sí, <u>cuando no hay garantías a informar.</u> |
|             |                  |             | 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)  | Sí, <u>cuando no hay garantías a informar</u>  |
|             |                  |             | 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)    | Sí, <u>cuando no hay un umbral pactado</u>     |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo   | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                                     |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---|
|             |                  |             | 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 ("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)    | <a href="#">Sí, cuando no hay garantías a informar:</a> |
|             | <b>07</b>        |             |                              |  | <b>Tipo de registro</b>  | Char(2)      |   |
|             |                  | 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.<br>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).<br>Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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.<br>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  |



| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                              | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|---------------------|
|             |                  |             | 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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. | 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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. | Num(3)       | 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? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---------------------|
|             | 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.<br>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).<br>Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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.<br>En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen.<br>Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá expresar el valor de mercado en base a las normas sectoriales definidas por el supervisor respectivo. | Num(15,5)    | No                  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo  | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                                  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|--|--------------|--|
|             |                  |             | 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)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 100                          | Opciones: Gamma   | En este campo se informará el cambio que tendría Delta ( $\Delta$ ) si el precio del subyacente (S) varía en +1% respecto de su valor vigente (Gamma: $\Gamma = \partial \Delta / \partial S = \partial^2 V / \partial S^2$ ).   | Num(4,10)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 102                          | Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte ( <i>Credit value adjustment</i> ) | Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2.<br>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)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.   | Num(15,5)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.                | Num(15,5)    | Sí, cuando la información <a href="#">no aplica.</a> |

## 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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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</p> <p>2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante.</p> <p>2.1.2 Adquisición por cesión: Cuando el Participante asume las obligaciones y es cesionario de los derechos vinculados a un Contrato suscrito anteriormente por un tercero. 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.</p> <p>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).</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: 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 comprésion 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?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|--|
|             |                  |             |                              |  | 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.<br>2.4 Vigencia<br>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. |              |  |
|             |                  |             | 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)     | <a href="#">Sí, cuando Contraparte 1 no posee código LEI</a>   |
|             |                  |             | 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(910) | Sí, 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)     | Sí, solo si la contraparte 2 es local <u>y distinta de un Fondo administrado por una AGF o AFP que pose código LEI</u> |
|             |                  |             | 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)   | <a href="#">Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte</a>  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo  | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--|
|             |                  |             | 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)     | <a href="#">Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte Central local o extranjera.</a>      |
|             |                  |             | <u>11</u>                    | RUT Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1 | <u>E</u> 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)   | <a href="#">Sí, cuando información no aplica.</a>  |
|             |                  |             | 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)     | <a href="#">Sí, cuando información no aplica.</a>  |
|             |                  |             | 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)   | <a href="#">Sí, cuando el Agente de Cálculo no es local</a>  |
|             |                  |             | 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)     | <a href="#">Si Sí, cuando el Agente de cálculo no posee un LEI</a>                                   |
|             |                  |             | 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) | <a href="#">No</a>   |
|             |                  |             | 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)   | <a href="#">Sí, cuando evento de reporte es distinto de CES y ACS-, o el Cedente o Cesionario no</a> |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo              | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------|--|--------------|--|
|             |                  |             |                              |                           |  |              | <a href="#">posee un código LEI.</a>   |
|             |                  |             | 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)     | Sí, <a href="#">cuando</a> -evento de reporte es distinto de CES y ACS <a href="#">o el Cedente o Cesionario no posee un código LEI.</a> |
|             |                  |             | 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)   | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a>   |
|             |                  |             | 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)     | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a>   |



| 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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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.<br>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)    | Sí, <u>cuando no aplica.</u>                 |
|             |                  |             | 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)        | Sí, 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)        | Sí, 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   |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                       | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|------------------------------------|--|--------------|---|
|             |                  |             | 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)      | Sí, solo si modalidad de liquidación es entrega física.   |
|             |                  |             | 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 consideran 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         | <u>Sí, solo si el instrumento es SWP o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1.</u>   |
|             |                  |             | 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 <i>fixing</i> para cada uno de los flujos en la sección de calendario de flujos.  | Date         | <u>Sí, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física, el instrumento es SWP o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1.</u> |
|             |                  |             | 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         | Sí, <u>cuando el evento de reporte no es una modificación.</u>  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                          | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|--|--------------|--|
|             |                  |             | 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)      | <a href="#">Sí, solo cuando no se ha informado Monto prima/pago inicial recibida ni Monto prima/pago inicial entregada</a> |
|             |                  |             | 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)    | <a href="#">Sí, cuando no hay una prima o pago inicial recibido.</a>   |
|             |                  |             | 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)    | <a href="#">Sí, cuando no hay una prima o pago inicial entregado.</a>  |
|             |                  |             | 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   |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                           |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---|
|             |                  |             | 52                           | Fecha de efectiva de término o liquidación | Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.  | Date         | Sí, cuando el contrato no ha sido anticipado. |
|             |                  |             | 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 notional. 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.<br><br>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  |
|             |                  |             | 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.<br>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).            |
|             | 03               |             |                              |  | <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.<br><br>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.<br>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).<br>Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.   | Num(2)       | No  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                        | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|-------------------------------------|--|--------------|--|
|             |                  |             | 24                           | Opciones:<br>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)      | Sí, solo si el instrumento no es una opción <u>sobre un derivado</u> .   |
|             |                  |             | 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   |
|             |                  |             | 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)    | <u>No</u> , solo si instrumento es SWP o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1.  |
|             |                  |             | 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.   | VarCChar(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.  | VarCChar(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 Interest Rate Swap y que consideran un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contario se debe indicar la tasa de interés fija a recibir en el campo 61 para cada flujo del calendario de flujo.<br>Para el caso de una Opción, este campo corresponde a la Tasa de interés Strike.  | Num(4,10)    | Si, solo si el instrumento es SWP, <u>el N° de intercambios o flujos es mayor a 1</u> 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 Interest Rate Swap y que consideran un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contario se debe indicar la tasa de interés fija a recibir en el campo 70 para cada flujo del calendario de flujo.<br>Para el caso de una Opción, este campo corresponde a la Tasa de interés Strike. | Num(4,10)    | Si, solo si el instrumento es SWP, <u>el N° de intercambios o flujos es mayor a 1</u> o el tipo de tasa de interés a entregar es variable. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                                     | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---|
|             |                  |             | 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 Interest Rate Swap 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, <a href="#">el N° de intercambios o flujos es mayor a 1</a> 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 Interest Rate Swap 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, <a href="#">el N° de intercambios o flujos es mayor a 1</a> o el tipo de tasa de interés a entregar es fija. |
|             |                  |             | 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 entrada).     | Num(15,5)    | <a href="#">Sí, cuando la información no aplica.</a>  |
|             |                  |             | 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)    | <a href="#">Sí, cuando la información o aplica.</a>   |

| Sub-sección                      | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                                 |
|----------------------------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---|
| <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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0). | Num(2)       | No  |
|                                  |                  |             | 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)     | <a href="#">Sí, cuando la información no aplica</a> |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                                | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--|
|             |                  |             | 60, 69                       | Spread sobre tasa de interés variable       | Spread que recibe/entrega la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable  | Num(4,10)    | Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es fija.        |
|             |                  |             | 61, 70                       | Tasa de interés fija                        | Tasa de interés fija a recibir/entregar por la Contraparte 1.   | Num(4,10)    | Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es variable.    |
|             |                  |             | 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         | Sí, <u>cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es fija.</u> |
|             |                  |             | 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)    | Sí, <u>cuando no hay intercambio de capital.</u>               |



| Sub-sección                 | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-----------------------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---------------------|
| <b>2. Pagos del Periodo</b> |                  |             |                              |  |   |              |                     |
|                             | 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          | 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                  |
|                             |                  |             | 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 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                  |
|                             |                  |             | 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> |                  |             |                              |  |  |              |  |
|                     | 06               |             |                              | <b>Tipo de registro</b>  | <u>Esta sección se debe completar cuando aplica informar garantías o umbrales.</u>   | 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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.   | Char(3)      | <u>Sí, cuando no hay garantías a informar.</u> |
|                     |                  |             | 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.<br>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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. | Varchar(52)  | <u>Sí, cuando no hay garantías a informar.</u> |

| 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 la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.   | Num(15,5)    | Sí, <a href="#">cuando no hay un umbral pactado.</a>    |
|             |                  |             | 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)    | Sí, <a href="#">cuando no hay garantías a informar.</a> |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo   | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---------------------|
|             | <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.<br>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).<br>Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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                  |
|             |                  |             | 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.<br>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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. | Varchar(52)  | No                  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                          | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|--|--------------|---------------------|
|             |                  |             | 84;88                        | Tipo activo en garantía               | <p>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.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p> | Char(4)      | No                  |
|             |                  |             | 84;88                        | Porcentaje tipo de activo en garantía | <p>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.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p> | Num(3)       | No                  |

| Sub-sección                | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                               | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|----------------------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---------------------|
| <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.<br>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).<br>Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.<br>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.<br>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                  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo  | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                                  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|--|--------------|--|
|             |                  |             | 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)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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: $\Delta = \partial V / \partial S$ ).  | Num(4,10)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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: $\Gamma = \partial \Delta / \partial S = \partial^2 V / \partial S^2$ ).   | Num(4,10)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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: $v = \partial V / \partial \sigma$ ).  | Num(4,10)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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.<br>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)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.                                    | Num(15,5)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.       | Num(15,5)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |

## 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.<br>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</p> <p>2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante.</p> <p>2.1.2 Adquisición por cesión: Cuando el Participante asume las obligaciones y es cesionario de los derechos vinculados a un Contrato suscrito anteriormente por un tercero.</p> <p>2.2 Modificación</p> <p>Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante.</p> <p>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).</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: 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> | 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<br/>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)     | Sí, <a href="#">cuando Contraparte 1 no posee código LEI.</a>   |
|             |                  |             | 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(109) | Sí, 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)     | Sí, <a href="#">solo cuando la contraparte 2 es local, y distinta de un Fondo administrado por una AGF o AFP que pose código LEI.</a> |
|             |                  |             | 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)   | <a href="#">Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte Central local.</a>              |
|             |                  |             | 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)     | <a href="#">Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte Central local o extranjera.</a> |

| 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)   | Sí, <a href="#">cuando información no aplica.</a>  |
|             |                  |             | 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)     | Sí, <a href="#">cuando información no aplica.</a>  |
|             |                  |             | 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)   | Sí, <a href="#">cuando el Agente de Cálculo no es local.</a>   |
|             |                  |             | 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)     | Sí, <a href="#">cuando el Agente de cálculo no posee un LEI</a>  |
|             |                  |             | 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) | <a href="#">No</a>   |
|             |                  |             | 16                           | RUT del Cedente o Cesionario  | RUT (Rol Único Tributario) de la Contraparte domiciliada o residente en Chile que cede (evento suscripción 2.1.2 "Adquisición por Cesión", evento de modificación 2.2.2 "Modificación de Contraparte por Cesión") o a la que se cede (evento término 2.3.2 "Cesión") un Contrato.<br>Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.   | Varchar(9)   | Sí, <a href="#">cuando el evento de reporte es distinto de CES y ACS o el Cedente o Cesionario no es local.</a>            |
|             |                  |             | 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.<br>Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.  | Char(20)     | Sí, <a href="#">cuando el evento de reporte es distinto de CES y ACS o el Cedente o Cesionario no posee un código LEI.</a> |

| 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)   | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a>        |
|             |                  |             | 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)     | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a>        |
|             | <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)  | Sí, <a href="#">cuando no aplica</a>                        |
|             |                  |             | 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)      | Sí, <a href="#">cuando el instrumento no es una opción.</a> |
|             |                  |             | 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)      | Sí, <a href="#">cuando el instrumento no es una opción.</a> |
|             |                  |             | 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)      | Sí, <a href="#">cuando la modalidad de liquidación es por entrega física.</a>   |
|             |                  |             | 33                           | Fecha de inicio                    | Fecha en la cual comienzan a devengarse los intereses de la operación en favor de alguna de las contrapartes.   | Date         | <a href="#">Sí, solo si N° de intercambios o flujos es mayor a 1.</a>   |
|             |                  |             | 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         | <a href="#">Sí, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1.</a> |
|             |                  |             | 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         | <a href="#">No</a>  |
|             |                  |             | 37                           | Fecha de inicio de la Modificación | Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una Modificación.  | Date         | Sí, 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?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|--|--------------|--|
|             |                  |             | 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)      | <a href="#">Sí, solo cuando no se ha informado Monto prima/pago inicial recibida ni Monto prima/pago inicial entregada</a> |
|             |                  |             | 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)    | <a href="#">Sí, cuando no hay una prima o pago inicial recibido.</a>   |
|             |                  |             | 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)    | <a href="#">Sí, cuando no hay una prima o pago inicial entregado.</a>  |
|             |                  |             | 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   |
|             |                  |             | 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   |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo   | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?   |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---|
|             |                  |             | 47                           | Fecha <del>de</del> efectiva de término o liquidación anticipada | Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.   | Date         | <a href="#">Sí, cuando el contrato no ha sido anticipado.</a> |
|             |                  |             | 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.<br>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).                            |



| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                              | Descripción   | Formato dato        | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|---------------------|--|
|             | 03               |             |                              |   | <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.<br>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   |
|             |                  |             | 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 | 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)           | Sí, solo si <u>el</u> 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)           | Sí, solo si <u>la</u> 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   |

| Sub-sección                 | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                             | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-----------------------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---------------------|
| <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 fueren 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.<br>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                  |
|                             |                  |             | 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.<br>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.<br>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                  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo   | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|--|
|             | 06               |             |                              | <b>Tipo de registro</b>  | <u><a href="#">Esta sección se debe completar cuando aplica informar garantías o umbrales.</a></u>  | 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.<br>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)      | <u>No</u>  |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.  | Char(3)      | <u><a href="#">Sí, cuando no hay garantías a informar.</a></u> |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. | Varchar(52)  | <u><a href="#">Sí, cuando no hay garantías a informar.</a></u> |
|             |                  |             | 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).<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.   | Num(15,5)    | <u><a href="#">Sí, cuando no hay un umbral pactado</a></u>     |
|             |                  |             | 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").<br>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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a  | Num(15,5)    | <u><a href="#">Sí, cuando no hay garantías a informar.</a></u> |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. |  |  |
|--|--|--|--|--|--|--|--|

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo   | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---------------------|
|             | <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.<br>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                  |
|             |                  |             | 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.<br>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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. | 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.<br>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.  | Char(4)      | No                  |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                          | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|--|--------------|---------------------|
|             |                  |             | 60;64                        | Porcentaje tipo de activo en garantía | <p>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.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p> | Num(3)       | No                  |

| Sub-sección                | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo                             | Descripción  | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                                  |
|----------------------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|--|
| <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   |
|                            |                  |             | 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)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|                            |                  |             | 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)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo  | Descripción   | Formato dato | ¿Puede venir vacío?                                  |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--|
|             |                  |             | 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: $\Gamma = \partial\Delta/\partial S = \partial^2V/\partial S^2$ ).  | Num(4,10)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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.<br>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)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.  | Num(15,5)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |
|             |                  |             | 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.<br>En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.      | Num(15,5)    | Sí, <a href="#">cuando la información no aplica.</a> |



