



BANCO CENTRAL DE CHILE
GERENCIA DIVISION INTERNACIONAL
Gcia. Cambios Internacionales y Política Comercial

Santiago, 28 de noviembre de 2003

CARTA CIRCULAR
BANCOS N° 455

ANT.: Circular 797 del 19 de noviembre de 2003.

MAT: Especificaciones Técnicas de archivo enviado vía SINACOFI.

SEÑOR GERENTE:

Me permito comunicar a usted que, a partir del **02 de diciembre de 2003**, se requerirá que en el archivo (FWD) mediante el cual se envían al Banco Central las operaciones forward a través de la red SINACOFI, se incorporen los siguientes nuevos Códigos e Instrumentos por operaciones de derivados que se deben reportar de acuerdo al Formulario contenido en el Anexo N°1 del Manual de Procedimientos y Formularios de Información del Compendio de Normas de Cambios Internacionales: 06, Fx Swap; 07, Cross Currency Swap (Capital); 08, Cross Currency Swap (Interés) y; 09, Dólar Observado.

Las instrucciones acerca del modo de informar estos códigos e instrumentos está contenida en la Circular del Banco Central de Chile citada en antecedentes.

No obstante, se hace presente que el código de instrumento Fx Swap se debe usar obligatoriamente toda vez que una operación, ya sea de compra o venta de moneda extranjera en un instrumento derivado esté asociada, por idéntico monto, a una operación inversa en el mercado de cambios contado. Asimismo, también es del caso destacar que los códigos 07 y 08, se deben usar para diferenciar el capital y los intereses en operaciones del tipo Cross Currency Swap. Finalmente, el código 09 se debe indicar para informar operaciones de derivados en cuyo precio se indique como precio pactado, la referencia no numérica "Dólar Observado".

Para los efectos señalados, el citado archivo computacional deberá ser generado considerando lo establecido en el instructivo de Especificaciones Técnicas que se adjunta, el cual ha sido modificado exclusivamente en lo que a "Observaciones" se refiere.

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

Saluda atentamente a usted,

GLORIA PEÑA
GERENTE CAMBIOS INTERNACIONALES
Y POLITICA COMERCIAL

Incluso: Lo citado (3 hojas)

INSTRUCTIVO ESPECIFICACIONES TECNICAS

1. ARCHIVO DE CARATULA DE CONTRATO FORWARD

Descripción del Registro

Largo registro: 38

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

2. ARCHIVO DE CONTRATO FORWARD

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

2.1 Registro de control inicio

Largo registro : 151

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

(*) Rellenar flag de control con "IIIIIIII"

(**) Debe decir FWD – CONTRATO FORWARD

2.2 Registro de contrato

Largo registro : 156

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

2.3 Registro de control término

Largo registro : 151

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

(*) Rellenar flag de control con "FFFFFFFFFF"

OBSERVACIONES:

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

- 01: Forward
- 02: Futuro;
- 03: Opción Call
- 04: Opción Put

05: Swap

06: Fx Swap

07: Cross Currency Swap (Capital)

08: Cross Currency Swap (Interés)

09: Dólar Observado

99: Otro

Nota: El código 09 se indicará exclusivamente en el caso en que el precio o paridad, según corresponda, que determina el valor de intercambio de las monedas involucradas en el contrato, sea el “Dólar Observado” y en el precio forward se deberá informar valor cero(0)

2. En el campo Código Sector Económico Contraparte, se deberán ingresar tres dígitos numéricos. Su relación se encuentra contenida en la siguiente dirección:

<http://www.bcentral.cl/esp/normativa/cambiointernacional/manual/pdf/CapIAnexo5.pdf>

(ver la página 36 del citado Anexo 5)

3. Los Usuarios que tengan alguna duda respecto al mencionado archivo computacional podrán canalizar sus inquietudes al Banco Central de Chile, enviando un e-mail a la cuenta de correo electrónico hmatius@bcentral.cl o alternativamente comunicándose con el Señor Hugo Matus M., Jefe de Proyecto de la Gerencia de Informática, al teléfono 670-2389.