



BANCO CENTRAL DE CHILE

CARTA CIRCULAR

Bancos	N° 636
Filiales bancarias comprendidas en el art. 70 letra a) de la LGB	N° 1
Entidades MCF no bancarias	N° 2
Otras entidades fiscalizadas CMF	N° 2
Otros domiciliados o residentes en Chile	N° 2

- ANT.: 1. 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.
2. Circular N° 3013-827, de 15 de julio de 2019, que informa incorporación del Capítulo III.D.3.1 “Reglamento Operativo del Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (RO-SIID)” al Compendio de Normas Financieras.

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

Santiago, 12 de marzo de 2020

Señor Gerente:

Adjunto a la presente, sírvase encontrar documento de Especificaciones Técnicas y Tablas relativas al Reglamento Operativo del Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (RO-SIID), contenido en el Capítulo III.D.3.1 del Compendio de Normas Financieras (CNF) del Banco Central de Chile (BCCh).

Este instructivo define y explica las estructuras de los archivos que deben ser proporcionados por los Participantes del SIID, en forma directa o a través de sus Agentes Autorizados, según los diversos sistemas de información dispuestos por el BCCh para dar cumplimiento a lo establecido en el RO-SIID. Además, se proporcionan las tablas y códigos que deben considerarse para la elaboración de estos archivos.



BANCO CENTRAL DE CHILE

Cabe recordar que la regulación aplicable al SIID, comprendida en los Capítulos III.D.3 y III.D.3.1 del CNF, y las presentes instrucciones, están dirigidos a las entidades que contarán con el carácter de “Participantes del SIID”, de conformidad con el N°1 de la Letra B del Capítulo III.D.3, el cual contempla las siguientes categorías de “Participantes” obligados a reportar a dicho Sistema sus operaciones de derivados en que sean parte o intervengan, una vez que esta normativa entre a regir:

- i. Empresas bancarias establecidas en Chile, y sus sociedades filiales a que se refiere el artículo 70 letra a) de la Ley General de Bancos, cuando dichas filiales deban reportar sus operaciones de derivados al SIID, conforme lo determine la Comisión para el Mercado Financiero (CMF) de conformidad con sus facultades legales (todas ellas referidas en el Capítulo III.D.3 como “Empresas Bancarias”);
- ii. Entidades que forman parte del Mercado Cambiario Formal y son diversas de empresas bancarias (“Entidades MCF no bancarias”);
- iii. Otras personas o entidades no bancarias, que no formen parte del MCF, pero que sean instituciones del mercado financiero sujetas a la fiscalización de la CMF y que correspondan a corredores de bolsa o agentes de valores regulados por la Ley N° 18.045, Sociedades Administradoras Generales de Fondos de la Ley N° 20.712, respecto de los fondos que administren, y compañías de seguros o entidades nacionales de reaseguro (“Otras Entidades Fiscalizadas CMF”); y
- iv. Demás personas domiciliadas o residentes en Chile, excluyendo las ya señaladas, en cuanto realicen operaciones con instrumentos derivados con personas domiciliadas o residentes en el exterior (“Otros domiciliados o residentes en Chile”), como resultaría ser el caso de las Administradoras de Fondos de Pensiones, respecto de los Fondos de Pensiones a su cargo.

De acuerdo con lo indicado, y según lo establecido en el Acuerdo de Consejo N° 2236-01-190711, la vigencia del Capítulo III.D.3 y del RO-SIID se fijó a contar del 3 de noviembre para las entidades bancarias y sus filiales (“Empresas Bancarias”), contempladas en el numeral 1 literal i) de la Letra B del citado Capítulo, y a contar de mayo de 2021 para los demás Participantes del SIID.

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).

Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (SIID)
Reglamento Operativo (RO-SIID)

SISTEMA INTEGRADO DE INFORMACIÓN SOBRE TRANSACCIONES DE DERIVADOS (SIID)

**Especificaciones Técnicas y Tablas relativas al Reglamento Operativo del Sistema
Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (RO-SIID)**

I. INTRODUCCIÓN

El presente instructivo explica el proceso de elaboración de los archivos en formato CSV requeridos para el reporte de instrumentos derivados en el SIID. Se recomienda leer este documento en conjunto con el Reglamento Operativo (RO-SIID).

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 a 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 a las siguientes especificaciones:

Header: largo 20 caracteres, con la estructura:

XXXXXXXXXXCCCAAAMMDD

Donde:

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

CCC Código del reporte según Tabla 1.

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

Tabla 1. Códigos, según tipo de reporte y subyacente

Código	Nombre del 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. Sin embargo, sí es necesario que cada línea contenga las *Primary key*, de su respectiva sección, y luego los campos correspondientes a lo largo de la fila, según el que corresponda de acuerdo al tipo de subyacente o sistema a reportar. Se debe considerar que, para las secciones sobre pagos y sobre 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 pagos
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
Formato archivo	CSV (<i>comma-separated values</i>)	
Fecha	Date: yyyy-mm-dd	2020-11-05
Fecha Suscripción	Datetime: yyyy-mm-ddThh:mm:ss	2020-11-05T14:31:46
RUT	Varchar(9) sin puntos, con dígito verificador y sin guion	999999999
Montos	Num(15,5), corresponde a un máximo de 15 enteros y a un máximo de cinco decimales	5000000.555
Tasas /Spread	Num(4,10), corresponde a un máximo de 4 enteros y a un máximo de 10 decimales	2.75
Separador de decimales	“ . ” (punto)	
Separador de miles	Sin separador de miles	
Separador de campos	“ ; ” (punto y coma)	
Campos nulos o sin datos	Se muestran sin espacios	
Alineamiento de los campos:	Los campos se informan sin alinear, ya que están expresados con separadores de campo.	
Tipo de registro:	Char(2) Orden de las secciones. Se recomienda que se informen en forma ascendente, pero se procesarán independientemente del orden.	01
Fin de línea	Para finalizar el último valor de una línea de información, sólo se informa el valor. No se debe agregar ningún carácter.	
Monedas	Norma ISO 4217, alpha -3	CLP
Países	Norma ISO 3166-1, alpha -3	CHL
Plataforma de negociación	MIC “Market Identifier Code” Norma ISO 10383, alpha -4	XBCL
Convenio marco	Char(25) Tabla 11 Convenio Marco + número convenio	ISDA987654321

V. TABLAS Y CÓDIGOS

Para la elaboración de los archivos se deberá considerar el listado de tablas y códigos definidos en el Anexo 1, en cada uno de sus Sistemas.

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 CSV

Ejemplo de un archivo diario, se presenta en el anexo 3.

ANEXOS

ANEXO 1: DETALLE DE TABLAS Y CÓDIGOS DEL SIID

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.	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 (Tasas de Interés)	CAP
Opción <i>Floor</i>	I (Monedas)	FLR
<i>Interest Rate Swap</i>	I (Monedas)	SWP
Otros	I, II y III (Monedas, Tasas de Interés y Renta fija, respectivamente)	OTR

Tabla 5: Clase de Opción

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

Tabla 6: Tipo de Posición

Descripción	Código
Compradora	BYER
Vendedora	SLLR

Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente

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

Tabla 8: Modalidad de Liquidación

Descripción	Código
Compensación	CO
Entrega Física	EF

Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés

Descripción	Código
Tasa fija	FIXEDRT
TNA o Tasa nominal anual (Índice Cámara Promedio –ABIF/GRSS–)	TNAICPO
TRA o Tasa real anual (Índice Cámara Promedio Real –ABIF/GRSS–)	TRAICPO
TAB en UF a 90 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo reajustables en UF –ABIF/GRSS–)	TABUF3M
TAB en UF a 180 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo reajustables en UF a 180 días –ABIF/GRSS–)	TABUF6M
TAB en UF a 360 días (Tasa de interés promedio ponderada de captaciones reajustables en UF a 360 días –ABIF/GRSS–)	TABU12M
TAB nominal a 30 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en pesos chilenos. –ABIF/GRSS–)	TABN01M
TAB nominal a 90 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en pesos chilenos –ABIF/GRSS–)	TABN03M
TAB nominal a 180 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en pesos chilenos –ABIF/GRSS–)	TABN06M
TAB nominal a 360 días (Tasa de interés promedio ponderada de captaciones en pesos chilenos a 360 días. –ABIF/GRSS–)	TABN12M
TADO a 30 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO01M
TADO a 60 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO02M
TADO a 90 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO03M
TADO a 180 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO06M
TADO a 360 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO12M
<i>Prime Rate</i>	PRIMERT
LIBOR en Dólares de los EE.UU. <i>overnight</i> (ICE)	US000ON
LIBOR en Dólares de los EE.UU. a 30 días (ICE)	US0001M

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

Tabla 10: Objetivo de la Operación

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

NOTA: La clasificación de objetivos de la operación de derivados descrita en la tabla anterior, se corresponde con la Norma Internacional de Información Financiera (IFRS). Las categorías de “Negociación” y “Cobertura de Riesgo de Posiciones de Balance”, corresponderán a instrumentos financieros derivados clasificados contablemente para negociación. La categoría “Cobertura de Riesgo de Posiciones de Balance” podrá ser utilizada por bancos y sus filiales que cuenten con la separación de sus mesas de dinero entre la actividad de negociación (trading) y la gestión de activos y pasivos (ALM) y que efectúen coberturas de riesgo de las posiciones del balance, que no sean designadas como coberturas contables. Aquellos Participantes que no cuenten con lo anteriormente señalado, deberán informar la totalidad de los instrumentos en la categoría de “Negociación”.

Tabla 11: Convenio Marco

Descripción	Código*
Condiciones Generales para Contratos de Derivados en el Mercado Local, aprobadas por la Asociación de Bancos e Instituciones Financieras y reconocidas por el Banco Central de Chile.	CCGG + número de contrato marco.
International Swaps and Derivatives Association.	ISDA+ número de contrato marco
Otros convenios no contemplados previamente.	OTRO+ número de contrato marco
No está sujeto a convenio marco.	NOSU

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

Tabla 12: Garantías

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

Tabla 13: Cláusula de Recouping

Descripción	Código
Con cláusula de Recouping	Y
Sin cláusula de Recouping	N

Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado

Descripción	Código
A favor de la Contraparte 1, con liquidación	CO1
A favor de la Contraparte 1, sin liquidación	C1S
A favor de la Contraparte 2, con liquidación	CO2
A favor de la Contraparte 2, sin liquidación	C2S
Opcional ambas partes, con liquidación	AMP
Opcional ambas partes, sin liquidación	AMS
Sin cláusula de término anticipado	NOT

Tabla 15: Compresión de Cartera

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

Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía

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

Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado

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

Tabla 18: Método de Valorización

Descripción	Código
Valor razonable a precios de mercado (mark-to-market)	M
Valor razonable utilizando modelos (mark-to-model)	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
1.A. Información general						
	01				Tipo de registro	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)
		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)
		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
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)
			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, sobre operaciones con instrumentos derivados.	Char(1)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			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>Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la celebración de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar un evento de suscripción para cada instrumento comprendido en la estructura.</p> <p>2.2 Modificación</p> <p>Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante.</p> <p>2.2.1 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</p> <p>Corresponde al evento de terminación o pérdida de vigencia de una operación reportada previamente por el Participante, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.</p> <p>2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación: Caducidad o término de forma anticipada del Contrato por causales contempladas en el Contrato respectivo, por causa legal, acuerdo de las partes, incluyendo la compresión u optimización de cartera.</p>	Char(3)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
					<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</p> <p>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)
			5	RUT contraparte del participante (Contraparte 2)	RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar.	Varchar(9)
			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)
			7	Nombre o razón social contraparte 2	Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.	Varchar(150)
			8	País Contraparte 2	Código del país de residencia o domicilio de la Contraparte 2, de acuerdo a la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)
			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)
			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)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			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)
			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)
			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)
			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)
			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)
			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)
			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)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			56	Plataforma de Negociación	Código de la Plataforma de Negociación en la cual fue pactado el contrato de derivado, según código MIC (<i>Market Identifier Code</i>) de la norma ISO 10383. En el caso que el contrato fuese negociado fuera de Bolsa, se deberá indicar en este campo el código "OTC".	Char(4)
			57	RUT Intermediario	RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario (<i>Broker</i>) que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Varchar(9)
			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)
	02				Tipo de registro	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)
		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)
		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
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)
			21	Instrumento	Tipo de instrumento al que corresponde la operación informada, según la Tabla de Instrumentos.	Char(3)
			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)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			22	Opciones: Clase	Clase de opción a que corresponde la operación informada, de acuerdo a la modalidad de ejercicio pactada en el Contrato, según lo señalado en la Tabla Clase de Opción.	Char(2)
			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)
			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)
			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)
			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 pagos.	Date
			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. 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
			37	Fecha de término	Fecha en la cual vence o madura la operación de acuerdo a 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
			38	Fecha de pago de la operación	Fecha de la última liquidación de la operación.	Date
			39	Fecha de inicio de la Modificación	Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una Modificación.	Date
			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 una cesión, 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)
			44	Monto prima/pago inicial recibida(o)	Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.	Num(15,5)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			45	Monto prima/pago inicial entregada(o)	Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.	Num(15,5)
			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 a la norma sectorial correspondiente.	Char(3)
			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)
			50	País Jurisdicción del Contrato	Código del país correspondiente a la legislación y jurisdicción aplicable bajo la cual el Contrato está amparado, de acuerdo a la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)
			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)
			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)
			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)
			54	Fecha de efectiva de término o liquidación anticipada	Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.	Date
			55	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)
			59	Número total de intercambios o flujos	Número total de oportunidades (fechas) en las cuales pueden ocurrir liquidaciones de operaciones correspondientes a un intercambio de flujo y/o nocional, los cuales deberán ser detallados a continuación. Para un instrumento que se compone de un único intercambio o liquidación a futuro, este campo no debe ser reportado.	Num(4)
			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.	Num(5)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
					En el caso de agrupar (netear) distintos eventos de pagos, estos deberán corresponder a un mismo tipo, de acuerdo a la Tabla Tipo de Pago Efectuado.	
	03				Tipo de registro	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)
		SI	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)
		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
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)
			24	Opciones: Instrumento subyacente	Indicar si el ejercicio de la opción implica la entrada en vigencia de un nuevo derivado (ejemplo <i>swaption</i>). Si este es el caso, reportar el instrumento subyacente correspondiente, según lo señalado en la Tabla Opciones - Instrumento Subyacente.	Char(3)
			27	Moneda Comprada	Código de la moneda subyacente a recibir por la Contraparte 1 en cada fecha de pago o al vencimiento de la operación, según norma ISO 4217.	Char(3)
			28	Monto Moneda Comprada	Monto de la moneda subyacente a recibir por la Contraparte 1 al término de la operación.	Num(15,5)
			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)
			30	Monto Moneda Vendida	Monto de la moneda subyacente a entregar por la Contraparte 1 en cada fecha de pago o al término de la operación.	Num(15,5)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			31	Tipo de Tasa de Interés a recibir	Indicar si la tasa de interés recibida por la Contraparte 1 es fija o una de tipo variable, según lo señalado en la Tabla Tipo de Tasa de Interés.	Char(7)
			32	Tipo de Tasa de Interés a entregar	Indicar si la tasa de interés entregada por la Contraparte 1 es fija o una de tipo variable, según lo señalado en la Tabla Tipo de Tasa de Interés.	Char(7)
			36	Fecha <i>fixing</i> 2	Fecha final del período a considerar en la <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
			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 "/" (por ejemplo, CLP/USD corresponde a pesos chilenos por un dólar de Estados Unidos de América).	Char(7)
			41	Precio Pactado a Futuro (Tipo Cambio Futuro)	Tipo de cambio a futuro, el cual debe ser expresado conforme a la "Convención Tipo de Cambio" definida en el Contrato. Para el caso de una opción, este campo corresponde al Precio Strike. Para operaciones que se suscriban con precio futuro desconocido al momento de su cierre, este campo no deberá ser completado. Al momento de conocerse el precio de intercambio, este deberá ser informado mediante una modificación.	Num(15,5)
			42	Puntos Forward	Diferencia entre el Precio Pactado a Futuro y el Precio Spot considerado en la negociación.	Num(4,10)
			46	Precio barrera de entrada (<i>Knock-in</i>)	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción podrá ser ejercida. Debe ser informado cuando la operación corresponda a una opción con barrera del tipo " <i>up-and-in</i> " o " <i>down-and-in</i> ". En el primer caso, el precio del subyacente debe subir hasta un determinado nivel (el precio barrera de entrada) para que el derecho que confiere el instrumento se active o sea ejercido; en el segundo caso, el precio del subyacente debe bajar hasta un determinado nivel para que la opción sea válida (precio barrera de entrada).	Num(15,5)
			47	Precio barrera de salida (<i>Knock-out</i>)	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción no podrá ser ejercida. Debe ser informado cuando la operación corresponda a una opción con barrera del tipo " <i>up-and-out</i> " o " <i>down-and-out</i> ". En el primer caso, la opción solo puede ejercerse válidamente mientras el precio del subyacente no alcance un determinado nivel (el precio barrera de salida); en el segundo caso, el precio del subyacente se debe mantener sobre un determinado nivel (precio barrera de salida) para que la opción se mantenga activa o sea ejercida.	Num(15,5)

1.B. Calendario de Flujos

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
	04				Tipo de registro	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)
		SI	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)
		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
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)
			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)
				Tipo de flujo	Código del tipo de flujo que se está reportando. E: entrega - R: recibido	Char(1)
			61/71	Factor sobre Tasa de Interés Variable	Factor que multiplica la tasa variable que recibe la Contraparte 1.	Num(4,3)
			62/72	Spread sobre tasa de interés variable	Spread que recibe/entrega la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable	Num(4,10)
			63/ 73	Tasa de interés fija	Tasa de interés fija a recibir/entregar por la Contraparte 1.	Num(4,10)
			64/74	Fecha de fixing para tasa de interés	Fecha que se considera para la tasa de interés variable de referencia utilizada en el cálculo de intereses del flujo a recibir/entregar por la Contraparte 1, según se estipule en el Contrato.	Date
			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

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			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
			67/77	Monto notional aplicable al flujo	Monto notional que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a recibir/entregar por la Contraparte 1.	Num(15,5)
			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)
			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)
	05				Tipo de registro	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)
		SI	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)
		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
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			81	Correlativo de registro de pago	Correlativo del registro de pago a informar.	Num(5)
				Pago recibido/entregado (R/E)	Código del tipo de pago que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)
			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
			83/84	Monto pago (recibido/entregado)	Monto recibido/entregado por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor correspondiente al pago total generado por la estructura de derivados en cada uno de los instrumentos que la componen.	Num(15,5)
			85	Tipo de pago efectuado	Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado.	Char(3)
	06				Tipo de registro	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)
		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)
		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
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se esta reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)
			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)
			87/91	Identificador de la garantía (o portafolio) entregada/recibida	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)
			89/93	Monto umbral ("Threshold") Entregada/Recibida	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)
			90/94	Valor garantía (entregada/recibida)	Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas 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)
	07				Tipo de registro	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)
		SI	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
		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
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)
			87,91	Identificador de la garantía (o portafolio) entregada/recibida	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías entregadas/recibidas que respaldan el Contrato. Este código debe ser repetido para todas las operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a monedas y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Varchar(52)
			88;92	Tipo activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Char(4)
			88;92	Porcentaje tipo de activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Num(3)
	08				Tipo de registro	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)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
		SI	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)
		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
		SI	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)
			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)
			96	Moneda de valorización	Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.	Char(3)
			97	Valor de mercado	Valor de mercado o valor razonable neto del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen. Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá expresar el valor de mercado en base a las normas sectoriales definidas por el supervisor respectivo.	Num(15,5)
			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)
			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)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			100	Opciones: Gamma	En este campo se informará el cambio que tendría Delta (Δ) 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)
			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 (σ) varía en +1 punto porcentual respecto del valor utilizado en la valoración de la opción (Vega: $v = \partial V/\partial \sigma$).	Num(4,10)
			102	Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte (<i>Credit value adjustment</i>)	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2. En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones respecto de la Contraparte 2, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo. En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones, asociados a dos o más Contrapartes, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)
			103	Ajuste a la valorización por <i>BID-OFFER Spread</i>	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por <i>BID-OFFER Spread</i> de la cartera de contratos de derivados de monedas, para la Contraparte 1. En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)
			104	Otros ajustes a la valorización	Indicar monto de otros ajustes al Valor de Mercado Neto de la cartera de contratos de derivados de monedas de la Contraparte 1, distintos a los informados en los campos anteriores. En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)

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
1.A. Información general						
	01				Tipo de registro	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)
		SI	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)
		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
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)
			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, sobre operaciones con instrumentos derivados.	Char(1)
			2	Evento de reporte	Código que identifica el tipo de registro que será informado o reportado, según la Tabla Eventos de Reporte. Este podrá corresponder a: 2.1 Suscripción 2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante.	Char(3)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
					<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 compresión u optimización de cartera.</p> <p>2.3.2 Cesión: Transferencia a un tercero de un Contrato previamente reportado por el Participante (cedente).</p> <p>2.3.3 Anulación: Eliminación de la información referida a un Contrato informado previamente, debido a que este nunca existió (ej. duplicaciones, cotizaciones, error de información, entre otros) o bien no estaba afecto a la regulación de derivados de monedas del Capítulo III.D.3 del CNF y su respectivo Reglamento Operativo.</p> <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</p>	

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
					Contratos Vencidos, junto con la información de pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior. 2.4 Vigencia Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha del reporte, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vigentes, junto con la información sobre valorizaciones, garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior.	
			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)
			5	RUT Contraparte del Participante (Contraparte 2)	RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar.	Varchar(9)
			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)
			7	Nombre o Razón Social Contraparte 2	Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.	Varchar(150)
			8	País Contraparte 2	Código del país de residencia o domicilio de la Contraparte 2, de acuerdo a la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)
			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)
			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)
			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)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			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)
			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)
			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)
			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)
			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)
			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)
			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)
			55	RUT Intermediario	RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario (Broker) que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Varchar(9)
			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)
	02				Tipo de registro	Char(2)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
		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)
		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)
		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.	Datetime9)
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)
			21	Instrumento	Tipo de instrumento al que corresponde la operación informada, según la Tabla de Instrumentos.	Char(3)
			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)
			22	Opciones: Clase	Clase de opción a que corresponde la operación informada, de acuerdo a la modalidad de ejercicio pactada en el Contrato, según lo señalado en la Tabla Clase de Opción.	Char(2)
			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)
			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)
			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)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			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 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 pagos.	Date
			33	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. 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
			34	Fecha de término	Fecha en la cual vence o madura la operación de acuerdo a 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
			35	Fecha de pago de la operación	Fecha de la última liquidación de la operación.	Date
			36	Fecha de inicio de la Modificación	Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una Modificación.	Date
			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 una cesión, 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)
			42	Monto prima/pago inicial recibida(o)	Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.	Num(15,5)
			43	Monto prima/pago inicial entregada(o)	Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.	Num(15,5)
			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 a la norma sectorial correspondiente.	Char(3)
			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	Char(25)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
					restantes caracteres se debe indicar el número o código único asignado al Convenio Marco de contratación de derivados.	
			48	País Jurisdicción del Contrato	Código del país correspondiente a la legislación y jurisdicción aplicable bajo la cual el Contrato está amparado, de acuerdo a la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)
			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)
			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)
			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)
			52	Fecha de efectiva de término o liquidación anticipada	Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.	Date
			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)
			57	Número total de intercambios o flujos	Número total de oportunidades (fechas) en las cuales pueden ocurrir liquidaciones de operaciones correspondientes a un intercambio de flujo y/o notional, los cuales deberán ser detallados a continuación. Para un instrumento que se compone de un único intercambio o liquidación a futuro, este campo no debe ser reportado.	Num(4)
			76	Número total de registros de pagos	Número total de registros de pagos que serán informados para la operación, los cuales deberán ser detallados a continuación. En el caso de agrupar (netear) distintos eventos de pagos, estos deberán corresponder a un mismo tipo, de acuerdo a la Tabla Tipo de Pago Efectuado.	Num(5)
	03				Tipo de registro	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)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
		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)
		SI	31	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Datetime
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.	Num(2)
			24	Opciones: Instrumento subyacente	Indicar si el ejercicio de la opción implica la entrada en vigencia de un nuevo derivado (ejemplo <i>swaption</i>). Si este es el caso, reportar el instrumento subyacente correspondiente, según lo señalado en la Tabla Opciones - Instrumento Subyacente.	Char(3)
			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)
			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.	Num(15,5)
			29	Tipo de Tasa de Interés a recibir	Indicar si la tasa de interés recibida por la Contraparte 1 es fija o una de tipo variable, según lo señalado en la Tabla Tipo de Tasa de Interés.	Char(7)
			30	Tipo de Tasa de Interés a entregar	Indicar si la tasa de interés entregada por la Contraparte 1 es fija o una de tipo variable, según lo señalado en la Tabla Tipo de Tasa de Interés.	Char(7)
			37	Tasa de interés fija a recibir	Tasa fija a recibir por la Contraparte 1. Este campo se debe completar sólo cuando existe un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso de haber más flujos se debe indicar la tasa de interés fija a recibir en el campo 57 para cada flujo del calendario de pago. Para el caso de una Opción, este campo corresponde a la Tasa de interés <i>Strike</i>	Num(4,10)
			38	Tasa de interés fija a entregar	Tasa fija a entregar por la Contraparte 1. Este campo se debe completar sólo cuando existe un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso de haber más flujos se debe indicar la tasa de interés fija en el campo 64 para cada flujo del calendario de pago.	Num(4,10)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			39	Spread sobre tasa de interés variable a recibir	Spread sobre la tasa variable que recibe la Contraparte 1. Este campo se debe completar sólo cuando existe un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso de haber más flujos se debe indicar el spread en el campo 56 para cada flujo del calendario de pago.	Num(4,10)
			40	Spread sobre tasa de interés variable a entregar	Spread sobre la tasa variable que entrega la Contraparte 1. Este campo se debe completar sólo cuando existe un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso de haber más flujos se debe indicar el spread en el campo 63 para cada flujo del calendario de pagos.	Num(4,10)
			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)
			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)

1.B. Calendario de Flujos

04			Tipo de registro			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)
	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)
	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

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)
			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)
				Tipo de flujo (E: entrega; R: recibido)	Código del tipo de flujo que se está reportando. E: entrega - R: recibido	Char(1)
			59, 68	Factor sobre Tasa de Interés Variable	Factor que multiplica la tasa variable que recibe la Contraparte 1.	Num(4,3)
			60, 69	Spread sobre tasa de interés variable	Spread que recibe/entrega la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable	Num(4,10)
			61, 70	Tasa de interés fija	Tasa de interés fija a recibir/entregar por la Contraparte 1.	Num(4,10)
			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
			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
			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
			65, 74	Monto nocial aplicable al flujo	Monto nocial que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a recibir/entregar por la Contraparte 1.	Num(15,5)
			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)
2. Pagos del Periodo						

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
	05				Tipo de registro	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)
		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)
		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
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)
			77	Correlativo de registro de pago	Correlativo del registro de pago a informar.	Num(5)
				Pago recibido/entregado (R/E)	Código del tipo de pago que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)
			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
			79,80	Monto pago (recibido/entregado)	Monto recibido/entregado por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor correspondiente al pago total generado por la estructura de derivados en cada uno de los instrumentos que la componen.	Num(15,5)
			81	Tipo de pago efectuado	Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado.	Char(3)
3. Garantías						

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
	06				Tipo de registro	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)
		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)
		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
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)
			82	Moneda de valorización de la garantía	Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Char(3)
			83, 87	Identificador de la garantía (o portafolio) entregada/recibida	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas que respaldan el Contrato de derivado. Este código debe ser repetido para todas las eventuales operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a tasas de interés y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Varchar(52)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			85, 89	Monto umbral ("Threshold") Entregada/Recibida	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)
			86, 90	Valor garantía (entregada/recibida)	Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas 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)
	07				Tipo de registro	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)
		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)
		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
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			83, 87	Identificador de la garantía (o portafolio) entregada/recibida	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas que respaldan el Contrato de derivado. Este código debe ser repetido para todas las eventuales operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a tasas de interés y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Varchar(52)
			84;88	Tipo activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Char(4)
			84,88	Porcentaje tipo de activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Num(3)
4. Valor de Mercado						
	08				Tipo de registro	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)
		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)
		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

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
		SI	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)
			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)
			92	Moneda de valorización	Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.	Char(3)
			93	Valor de mercado	Valor de mercado o valor razonable neto del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen. Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá expresar el valor de mercado en base a las normas sectoriales definidas por el supervisor respectivo.	Num(15,5)
			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)
			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)
			96	Opciones: Gamma	En este campo se informará el cambio que tendría Delta (Δ) 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)
			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 (σ) varía en +1 punto porcentual respecto del valor utilizado en la valoración de la opción (Vega: $v = \partial V / \partial \sigma$).	Num(4,10)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			98	Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte (<i>Credit value adjustment</i>)	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2. En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones respecto de la Contraparte 2, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo. En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones, asociados a dos o más Contrapartes, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)
			99	Ajuste a la valorización por <i>BID-OFFER Spread</i>	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por <i>BID-OFFER Spread</i> de la cartera de contratos de derivados de tasas de interés, para la Contraparte 1. En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)
			100	Otros ajustes a la valorización	Indicar monto de otros ajustes al Valor de Mercado Neto de la cartera de contratos de derivados de tasas de interés de la Contraparte 1, distintos a los informados en los campos anteriores. En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)

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
1.A. Información general						
	01	SI	3		Tipo de registro	Char(2)
				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)
		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)
		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)
			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, sobre operaciones con instrumentos derivados.	Char(1)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			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>Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la celebración de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar un evento de suscripción para cada instrumento comprendido en la estructura.</p> <p>2.2 Modificación</p> <p>Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante.</p> <p>2.2.1 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</p> <p>Corresponde al evento de terminación o pérdida de vigencia de una operación reportada previamente por el Participante, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.</p> <p>2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación: Caducidad o término de forma anticipada del Contrato por causales contempladas en el Contrato respectivo, por causa legal, acuerdo de las partes, incluyendo la compresión u optimización de cartera.</p>	Char(3)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
					<p>2.3.2 Cesión: Transferencia a un tercero de un Contrato previamente reportado por el Participante (cedente).</p> <p>2.3.3 Anulación: Eliminación de la información referida a un Contrato informado previamente, debido a que este nunca existió (ej. duplicaciones, cotizaciones, error de información, entre otros) o bien no estaba afecto a la regulación de derivados de monedas del Capítulo III.D.3 del CNF y su respectivo Reglamento Operativo.</p> <p>2.3.4 Vencimiento: Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha de término del Contrato, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vencidos, junto con la información de pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior.</p> <p>2.4 Vigencia Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha del reporte, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vigentes, junto con la información sobre valorizaciones, garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior.</p>	
			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)
			5	RUT Contraparte del Participante (Contraparte 2)	RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar.	Varchar(9)
			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)
			7	Nombre o Razón Social Contraparte 2	Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.	Varchar(150)
			8	País Contraparte 2	Código del país de residencia o domicilio de la Contraparte 2, de acuerdo a la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)
			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)
			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)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			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)
			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)
			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)
			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)
			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)
			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)
			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)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			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)
			50	RUT Intermediario	RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario (<i>Broker</i>) que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Varchar(9)
			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)
	02				Tipo de registro	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)
		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)
		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
			25	Instrumento	Tipo de instrumento al que corresponde la operación informada, según la Tabla de Instrumentos.	Char(3)
			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)
			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)
			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)
			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)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			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)
			33	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 pagos.	Date
			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
			35	Fecha de término	Fecha en la cual vence o madura la operación de acuerdo a 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
			36	Fecha de pago de la operación	Fecha de la última liquidación de la operación.	Date
			37	Fecha de inicio de la Modificación	Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una Modificación.	Date
			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 una cesión, 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)
			39	Monto prima/pago inicial recibida(o)	Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.	Num(15,5)
			40	Monto prima/pago inicial entregada(o)	Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.	Num(15,5)
			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)
			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	Char(25)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
					restantes caracteres se debe indicar el número o código único asignado al Convenio Marco de contratación de derivados.	
			43	País Jurisdicción del Contrato	Código del país correspondiente a la legislación y jurisdicción aplicable bajo la cual el Contrato está amparado, de acuerdo a la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)
			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)
			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)
			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)
			47	Fecha de efectiva de término o liquidación anticipada	Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.	Date
			48	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)
			52	Número total de registros de pagos	Número total de registros de pagos que serán informados para la operación, los cuales deberán ser detallados a continuación. En el caso de agrupar (netear) distintos eventos de pagos, estos deberán corresponder a un mismo tipo de acuerdo a la Tabla de Pago Efectuado.	Num(4)
	03				Tipo de registro	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)
		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)
		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)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			30	Moneda monto notional	Código de la moneda en la que está expresado el monto notional sobre el cual se calculan los flujos a intercambiar, según norma ISO 4217.	Char(3)
			31	Monto notional	Se debe indicar el monto notional de la operación.	Num(15,5)
			20	Tipo de Identificador del activo de renta fija subyacente	Tipo de identificador del activo de renta fija de acuerdo a lo indicado en la Tabla Tipo de Código de Activo Subyacente. Se debe utilizar de preferencia el código ISIN.	Char(7)
			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)
			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)
			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)
			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)
2. Pagos del Periodo					Los campos del pago están separados en "Recibidos" y "Entregados" en el Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras. Sin embargo, para facilitar la creación de los reportes por parte de los usuarios, estos campos fueron compilados en uno solo y se agregaron el campo de "Pago Recibido/Entregado" los cuales indican si el pago es entregado o recibido.	
	05				Tipo de registro	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)
		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)
		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

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			53	Correlativo de registro de pago	Correlativo del registro de pago a informar.	Num(5)
				Pago recibido/entregado (R/E)	Código del tipo de pago que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)
			54	Fecha de pago	Fecha de pago o liquidación. En el caso de informar más de un pago como registro agrupado, indicar la fecha correspondiente al pago más reciente.	Date
			55,56	Monto pago (recibido/entregado)	Monto recibido/entregado por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor correspondiente al pago total generado por la estructura de derivados en cada uno de los instrumentos que la componen.	Num(15,5)
			57	Tipo de pago efectuado	Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado.	Char(3)
	06				Tipo de registro	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)
		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)
		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
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)
			58	Moneda de valorización de la garantía	Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Char(3)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			59, 63	Identificador de la garantía (o portafolio) entregada/recibida	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas que respaldan el Contrato de derivado. Este código debe ser repetido para todas las eventuales operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a tasas de interés y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Varchar(52)
			61, 65	Monto umbral ("Threshold") Entregada/Recibida	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)
			62, 66	Valor garantía (entregada/recibida)	Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas por la Contraparte 1 como 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)
	07				Tipo de registro	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)
		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)
		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
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			59, 63	Identificador de la garantía (o portafolio) entregada/recibida	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas que respaldan el Contrato de derivado. Este código debe ser repetido para todas las eventuales operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a tasas de interés y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Varchar(52)
			60;64	Tipo activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Char(4)
			60;64	Porcentaje tipo de activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Num(3)
4. Valor de Mercado						
	08				Tipo de registro	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)
		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)
		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

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			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)
			68	Moneda de valorización	Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.	Char(3)
			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)
			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)
			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)
			72	Opciones: Gamma	En este campo se informará el cambio que tendría Delta (Δ) 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)
			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 (σ) varía en +1 punto porcentual respecto del valor utilizado en la valoración de la opción (Vega: $v = \partial V / \partial \sigma$).	Num(4,10)
			74	Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte (<i>Credit value adjustment</i>)	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2. En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones respecto de la Contraparte 2, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo. En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones, asociados a dos o más Contrapartes, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)

Sub-sección	Tipo de registro	Primary Key	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato
			75	Ajuste a la valorización por <i>BID-OFFER Spread</i>	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por <i>BID-OFFER Spread</i> de la cartera de contratos de derivados de tasas de interés, para la Contraparte 1. En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)
			76	Otros ajustes a la valorización	Indicar monto de otros ajustes al Valor de Mercado Neto de la cartera de contratos de derivados de tasas de interés de la Contraparte 1, distintos a los informados en los campos anteriores. En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)

ANEXO 3: EJEMPLO DE ARCHIVO 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 a: se supone el siguiente contrato (datos ficticios y sólo para fines referenciales):

Información del contrato:

RUT contraparte 1	12345678-5
Tipo de envío	Diario
Fecha de envío	15/01/2020
Identificador del contrato	98765
Fecha de suscripción	12/01/ 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	76317889-7
LEI cedente o cesionario	213800FQ9YXIEP9GZG11
Plataforma de negociación	XBCL
RUT intermediario	76317889-7
LEI intermediario	213800FQ9YXIEP9GZG11
Instrumento	CCS
Identificador del contrato para agente autorizado	ABD21453
Opciones-Clase	No aplica
Opciones: Posición en la operación	No aplica
Modalidad de liquidación	CO
Moneda de compensación	USD
Fecha de inicio	19-12-2018
Fecha fixing 1	16-12-2020
Fecha de término	17-12-2020
Fecha de pago de la operación	18-12-2020
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	SC
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	US0006M
Tipo de tasa de interés a entregar	TABUF6M
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 (Knock-in)	No aplica
Precio barrera de salida (Knock-out)	No aplica
Número del flujo	Según calendario
Tipo de flujo	Según calendario
Factor sobre tasa de interés variable	Según calendario
Spread sobre tasa de interés variable	Según calendario
Tasa de interés fija	Según calendario
Fecha de fixing para tasa de interés	Según calendario
Fecha de inicio del flujo	Según calendario
Fecha de término del flujo	Según calendario
Monto notional aplicable al flujo	Según calendario
Monto flujo como intercambio del capital	Según calendario
Moneda del monto como intercambio de capital	Según calendario

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 fixing para tasa de interés	31-07-2020
Fecha de inicio del flujo	01-02-2020
Fecha de término del flujo	01-08-2020
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 fixing para tasa de interés	31-07-2020
Fecha de inicio del flujo	01-02-2020
Fecha de término del flujo	01-08-2020
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 fixing para tasa de interés	31-01-2021
Fecha de inicio del flujo	02-08-2020
Fecha de término del flujo	01-02-2021
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 fixing para tasa de interés	31-01-2021
Fecha de inicio del flujo	02-08-2020
Fecha de término del flujo	01-02-2021
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 CSV del contrato anterior:

987654325DFX20200131
01;123456785;98765;2020-01-31T14:31:46;0;Y;NUE;213800PM785MT657TJ13;987654325;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;CHL;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;;;XBCL;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11
02;123456785;98765;2020-01-31T14:31:46;0;CCS;ABD21453;;;CO;USD;2020-02-01;2021-01-31;2021-02-01;2021-02-01;;;;;CFC;CCGG98765;CHL;SC;N;NOT;;N;2;
03;123456785;98765;2020-01-31T14:31:46;0;;USD;1000000;CLP;750000000;US0006M;TABUF6M;;USD/CLP;750;-5;;
04;123456785;98765;2020-01-31T14:31:46;0;1;R;;0.02;;2020-07-31;2020-02-01;2020-08-01;1000000;500000;USD
04;123456785;98765;2020-01-31T14:31:46;0;1;E;;0.05;;2020-07-31;2020-02-01;2020-08-01;750000000;375000000;CLP
04;123456785;98765;2020-01-31T14:31:46;0;2;R;;0.02;;2021-01-31;2020-08-02;2021-02-01;500000;500000;USD
04;123456785;98765;2020-01-31T14:31:46;0;2;E;;0.05;;2021-01-31;2020-08-02;2021-02-01;375000000;375000000;CLP