



Secretaría General

ACUERDO ADOPTADO POR EL CONSEJO DEL
BANCO CENTRAL DE CHILE EN SU SESIÓN EXTRAORDINARIA N° 2182E

Certifico que el Consejo del Banco Central de Chile, en su Sesión Extraordinaria N° 2182E, celebrada el 30 de octubre de 2018, adoptó el siguiente Acuerdo:

2182E-01-181030 — Publicación para comentarios de propuesta de normativa sobre nuevo Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras referido al “Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (SIID)”, junto a su respectivo Reglamento Operativo.

1. Disponer la publicación para consulta del marco general de regulación necesario para establecer un “Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (SIID)”. Esta regulación, está constituida por dos cuerpos normativos: el nuevo Capítulo III.D.3 y su correspondiente Reglamento Operativo (RO-SIID), los cuales integrarán el Compendio de Normas Financieras (CNF) del Banco Central de Chile (BCCh), incluidos en Anexo que forma parte integrante de este Acuerdo.

El propósito de este proceso de consulta es recabar comentarios de interesados y público en general que, en la medida que resulte apropiado, puedan ser incorporados en la regulación que finalmente resuelva dictar el BCCh.

2. El SIID persigue constituirse en un Repositorio de Transacciones de derivados *Over the Counter* (OTC) con la capacidad de recolectar, almacenar y registrar tales transacciones de forma eficiente y segura. Para tales efectos, el SIID será gestionado y operado directamente por el BCCh adhiriendo a principios internacionalmente aceptados para este tipo de Infraestructuras de los Mercados Financieros.

La finalidad fundamental para el establecimiento del SIID consiste en cumplir con los objetivos del BCCh de velar por la estabilidad de la moneda y el normal funcionamiento de los pagos internos y externos, contribuyendo de este modo a cautelar la estabilidad financiera. Asimismo, tiene como propósito permitir la compilación y publicación de las estadísticas macroeconómicas nacionales en esta materia.

Lo anterior, tendrá lugar de acuerdo al marco jurídico vigente, a través del ejercicio de las funciones estadísticas confiadas al BCCh y el desempeño de sus atribuciones en materia de operaciones de cambios internacionales y mediante la determinación de las normas y limitaciones aplicables a las operaciones de derivados que efectúen las empresas bancarias; contemplándose contar con la debida coordinación e intervención de la Superintendencia de Bancos e Instituciones Financieras (SBIF) – y, en su oportunidad, con la del organismo público que le suceda en el ejercicio de la función de supervisión bancaria -, quien además instruirá a sus entidades fiscalizadas en orden a remitir esta información a través del SIID, supervisando a su respecto el cumplimiento de la normativa en cuestión.



3. La publicación de la propuesta antes citada se efectuará en el sitio web institucional del Banco Central de Chile y el plazo para recibir comentarios se extenderá desde el día 30 de octubre, oportunidad en que se incluirá en el referido sitio electrónico, hasta el día 28 de diciembre, inclusive. El Banco Central dispondrá, en su oportunidad, la publicación en el sitio electrónico mencionado de los comentarios recibidos y dará a conocer las respuestas que ellos puedan merecerle, en los términos previstos en el referido Compendio.
4. Dejar constancia que la citada propuesta normativa contemplará, a su vez, ajustes de consistencia con lo dispuesto en el Capítulo IX del Compendio de Normas de Cambios Internacionales del Banco sobre Operaciones con Instrumentos Derivados y su respectivo Manual, para adecuar los requerimientos de información aplicables a los derivados cambiarios, refiriendo la entrega de información de esta especie a los mecanismos previstos por el SIID, de modo de centralizar y sistematizar la entrega de información al Banco y evitando la duplicidad en el requerimiento de información.

Estas adecuaciones serán informadas oportunamente, una vez recibidos y procesados los comentarios del actual proceso de consulta pública, de acuerdo a lo que al efecto se establezca en definitiva por el Banco Central de Chile.

5. Comunicar el presente Acuerdo al señor Superintendente de Bancos e Instituciones Financieras, para su conocimiento y demás fines pertinentes.

Atentamente,

MAURICIO ÁLVAREZ MONTTI
Ministro de Fe Subrogante

Incl.: Lo citado.

Santiago, 30 de octubre de 2018



CAPÍTULO III.D.3

SISTEMA INTEGRADO DE INFORMACIÓN SOBRE TRANSACCIONES DE DERIVADOS (SIID)

TÍTULO I

Organización General del SIID y atribuciones del Banco Central de Chile para su implementación

A. Antecedentes Generales

1. Un Repositorio de Transacciones (“TR” por su sigla en inglés) corresponde a una Infraestructura que mantiene un registro electrónico centralizado de datos de transacciones. Sus funciones consisten en la recolección, almacenamiento y diseminación de información relevante para el mercado y sus reguladores, y han sido desarrollados a nivel internacional de acuerdo con los siguientes objetivos fundamentales:
 - i. Aumentar la transparencia y disponibilidad de información en los mercados, tanto para las autoridades como para el público en general.
 - ii. Promover la estabilidad financiera, a través de una adecuada gestión de riesgos de las instituciones financieras, y de un monitoreo y supervisión efectiva por parte de las autoridades.
 - iii. Prevenir abusos de mercado, como consecuencia de un aumento de la transparencia de los mercados.

La importancia sobre el desarrollo de los TR tiene relación con parte de las lecciones fundamentales de la crisis financiera internacional iniciada el año 2008, en la cual se evidenciaron los riesgos para el sistema financiero asociados a los mercados de derivados *Over-The-Counter* (OTC) en los cuales tradicionalmente se toleraban ciertos grados de opacidad.

En este sentido, actualmente los TR se conciben internacionalmente como una de las infraestructuras de los mercados financieros (FMI, por sus siglas en inglés) particularmente en el caso de aquellos desarrollados para registrar transacciones de los mercados de derivados OTC. Este consenso internacional se formaliza por primera vez en la actualización de principios internacionales aplicables a la FMIs (PFMIs por sus siglas en inglés) publicados en 2012 por CPMI y IOSCO¹.

2. El Banco Central de Chile (“BCCh” o el “Banco”), en ejercicio de sus facultades legales, incorpora en este Capítulo el marco de regulación necesario para establecer el funcionamiento de un Sistema Integrado de Información sobre transacciones de Derivados (“SIID”), siguiendo las mejores prácticas y recomendaciones internacionales para TR y por lo tanto adhiriendo los PFMIs que resultan aplicables.

¹ Committee on Payments and Settlement Systems (CPSS) del Bank for International Settlements (BIS) y International Organization of Securities Commissions (IOSCO). “Principles for financial market infrastructures”. Abril 2012.



El SIID tiene por finalidad disponer de una infraestructura para registrar operaciones de derivados OTC en forma eficiente, segura y oportuna, de acuerdo al objetivo fundamental del BCCh consistente en velar por la estabilidad de la moneda y el normal funcionamiento de los pagos internos y externos, contribuyendo de este modo a cautelar la estabilidad financiera.

Asimismo, el SIID tiene como propósito permitir la compilación y publicación de las estadísticas macroeconómicas nacionales en esta materia.

El SIID realizará la recepción, procesamiento y análisis de la información actualizada sobre las operaciones de derivados OTC que reporten sus Participantes, en los términos contemplados en el presente Capítulo. El funcionamiento de esta infraestructura permitirá al BCCh generar estadísticas, informes y estudios técnicos sobre el mercado de derivados, para información y conocimiento del público en general, de las entidades que conforman el sistema financiero y de sus supervisores, conforme corresponda.

La Superintendencia de Bancos e Instituciones Financieras (SBIF) accederá directamente a la información proporcionada al SIID por las empresas bancarias y sus filiales, así como por las demás entidades sujetas a su fiscalización, de conformidad con sus facultades legales y lo señalado en la presente normativa y las instrucciones que dicho organismo dicte en virtud de lo dispuesto en el artículo 82 de la Ley Orgánica Constitucional del BCCh ("LOC"). Asimismo, cabe precisar que los Participantes del SIID tendrán acceso de manera sistematizada y ordenada a toda la información que hubieren reportado al SIID sobre las transacciones en las cuales cada uno de estos haya sido parte o intervenido.

Para los efectos del establecimiento y funcionamiento del SIID, las atribuciones legales del Banco y sus correspondientes regulaciones que sustentan el establecimiento y funcionamiento del SIID, corresponden a las siguientes:

- i. Las operaciones de cambios internacionales correspondientes a instrumentos derivados efectuadas por personas domiciliadas o residentes en Chile, están sujetas al marco de regulación definido de acuerdo a los Capítulos II y IX del Compendio de Normas de Cambios Internacionales del Banco (CNCI) y su Manual de Procedimientos y Formularios de Información (Manual del CNCI). En consecuencia, la obligación de informar operaciones con productos derivados, en virtud de la normativa cambiaria precitada, se deberá cumplir a través del SIID, en la forma y con la periodicidad contemplada en el presente Capítulo.

Se deja constancia que la regulación cambiaria aludida fue dictada de conformidad con el artículo 3º, en relación con el Párrafo Octavo del Título III de la LOC, y en especial de acuerdo con lo previsto en sus artículos 40 y 42.

- ii. Las operaciones con productos derivados en que al menos una de las contrapartes corresponda a una empresa bancaria establecida en el país, ya sea que involucren o no la realización de operaciones de cambios internacionales, están sujetas directamente a las obligaciones de información contenidas en este Capítulo de acuerdo a las facultades conferidas al Banco en el artículo 69 N° 6, inciso segundo de la Ley General de Bancos (LGB).

Cabe consignar que, adicionalmente a lo previsto en el presente Capítulo, las operaciones con productos derivados que las empresas bancarias pueden efectuar en el mercado local, en moneda nacional, se encuentran sujetas a las normas y limitaciones contenidas en los Capítulos III.D.1 y III.D.2 del Compendio de Normas Financieras del BCCh ("CNF"), este último también referido a otros inversionistas institucionales.



La regulación establecida en este Capítulo no modifica o incide en modo alguno en las demás disposiciones dictadas por el Banco aplicables a operaciones con productos derivados realizadas por empresas bancarias.

- iii. Los artículos 53 y 66, inciso final, de la LOC confieren, respectivamente, al Banco atribuciones para requerir al sector público la información que estime necesaria para el cumplimiento de su función estadística y, en su caso, para proceder a la divulgación de los antecedentes que recabe en términos globales, no personalizados y solo para fines estadísticos o de información general, lo cual se extiende además a la información cambiaria recabada.

El ejercicio de las competencias vinculadas con el cumplimiento de la función estadística, comprenderá la compilación de todos los antecedentes que se remitan al SIID, por una parte, en cumplimiento de la normativa cambiaria dictada por el BCCh; y, por otra, de conformidad con las exigencias de información sobre operaciones de derivados no cambiarios aplicables a las empresas bancarias, o a sus sociedades filiales para efectos de consolidación con el banco matriz, considerando para esto último las instrucciones impartidas por la SBIF en virtud de lo dispuesto en el artículo 70 letra a) de la LGB.

- iv. La implementación del SIID considera especialmente la supervigilancia que corresponde ejercer a la SBIF respecto del cumplimiento de las normas del presente Capítulo por parte de las empresas bancarias, en su condición de entidades sujetas a la fiscalización de dicho organismo, conforme a lo previsto en el artículo 82 de la LOC, así como de las exigencias de información que el mismo imparta a las sociedades filiales a que se refiere el artículo 70 letra a) de la LGB. Lo indicado, sin perjuicio que el citado artículo 82 de la LOC también faculta al BCCh para ejercer directamente dicha supervigilancia en materias cambiarias.

Para este efecto, tendrán aplicación los procedimientos de coordinación y cooperación que acuerden el BCCh y la SBIF, especialmente para fines del reporte, procesamiento y entrega de la información requerida por el SIID, teniendo presente el marco jurídico descrito y lo establecido en las normas pertinentes de la LGB. Del mismo modo, las entidades fiscalizadas por la SBIF, así como aquellas demás instituciones obligadas a proporcionarle información, deberán observar las instrucciones que dicho organismo supervisor les pueda impartir de acuerdo con sus facultades legales, en relación con la ejecución del presente Capítulo.

B. Participantes del SIID (entidades obligadas a reportar)

1. De acuerdo con lo indicado precedentemente, las entidades señaladas a continuación (“Participantes” o “Participantes del SIID”) deberán reportar al SIID la información que corresponda, según la clase de entidad y la naturaleza de la operación respectiva, observando las regulaciones contenidas en este Capítulo, su Reglamento Operativo (“RO-SIID”) y las instrucciones que imparta la SBIF para su ejecución.

- i. Empresas bancarias establecidas en Chile (“Empresas Bancarias”).

Para fines de lo dispuesto en este Capítulo, se entenderán también incluidas en esta categoría las sociedades filiales bancarias a que se refiere el artículo 70 letra a) de la LGB, conforme lo determine la SBIF de acuerdo a sus facultades legales, cuando dichas filiales deban reportar al SIID las operaciones de derivados en que las mismas sean parte o intervengan. El RO-SIID determinará la forma en que se individualizará a estas sociedades filiales, así como la manera y periodicidad en que deberán reportar y podrán consultar los antecedentes respectivos.



- ii. Personas jurídicas que el Banco ha autorizado a formar parte del Mercado Cambiario Formal (MCF), distintas de las empresas bancarias (“Entidades MCF no bancarias”).
- iii. Personas o entidades, distintas de empresas bancarias y que no forman parte del MCF, pero se encuentran sujetas a la fiscalización de la Comisión para el Mercado Financiero (“Entidades fiscalizadas CMF”).
- iv. Demás personas domiciliadas o residentes en Chile, excluyendo las ya señaladas en los literales anteriores, en cuanto realicen operaciones con instrumentos derivados con personas domiciliadas o residentes en el exterior (“Otros domiciliados o residentes en Chile”).

La información al SIID puede ser enviada directamente por los Participantes, o bien a través de agentes autorizados para estos efectos (“Agentes Autorizados”), los que podrán estar constituidos como: (i) filiales bancarias o sociedades de apoyo al giro bancario de conformidad a los artículos 70 y 74 de la LGB; (ii) bolsas de valores; (iii) sociedades administradoras de sistemas de compensación y liquidación de instrumentos financieros regidos por la Ley N°20.345; o (iv) empresas de depósito de valores constituidas de acuerdo a la Ley N°18.876 o sus filiales, sujetas a la fiscalización de la CMF.

Los Participantes deberán suscribir una solicitud de acceso al SIID, obligándose a observar los términos y condiciones establecidos en este Capítulo y su Reglamento Operativo. A través de esta solicitud se indicará si la información se entregará directamente o a través de uno o más Agentes Autorizados, individualizando a los mismos. El RO-SIID contendrá un modelo de solicitud de acceso.

Los Participantes del SIID deberán reportar sus operaciones de acuerdo con lo establecido en el siguiente cuadro:

↓ Participantes SIID Contraparte →	Empresas Bancarias ¹	Entidades MCF	Otros Residentes en Chile ²	No residentes en Chile ³
i. Empresas Bancarias ¹			✓✓	
ii. Entidades MCF no bancarias	✓		✓	✓
iii. Entidades no MCF, fiscalizadas CMF	✓		✓	✓
iv. Otros Residentes en Chile ²				✓

- ✓✓ : Reportan todos los contratos de derivados en los términos requeridos en el RO-SIID.
- ✓ : Reportan solo las transacciones de derivados que impliquen o puedan implicar una obligación en moneda extranjera, de acuerdo a la normativa cambiaria aplicable.
 1. Incluyendo filiales obligadas.
 2. Otros domiciliados o residentes en Chile, no bancos, no MCF y no fiscalizados por la CMF.
 3. Personas naturales o jurídicas establecidas en el exterior.



C. Transacciones que se deben reportar al SIID

1. Descripción de la información a reportar:

Los Participantes del SIID o sus Agentes Autorizados, según corresponda, deberán reportar la información señalada -a modo general- a continuación, dando cumplimiento a las instrucciones y especificaciones contenidas en el RO-SIID:

- i. **Evento de Reporte:** Condiciones de suscripción, modificación, término y vigencia de los respectivos contratos de derivados suscritos u otorgados por los Participantes.
- ii. **Agentes que participan en la operación de derivados:** Se identificará al Participante y su contraparte, así como a la persona que actuará como agente de cálculo y al cedente o cesionario de la respectiva operación, si corresponde. Para estos efectos, se utilizarán los números de identificación (RUT o LEI², según corresponda), nombre o razón social y país de residencia de cada uno de estos.
- iii. **Operación:** Se identificará al contrato de derivados correspondiente, junto al tipo de instrumento (*forwards, swaps, opciones, cross currency swaps* y otros); modalidad de liquidación, (compensación o entrega física); subyacente (tasas de interés, monedas o instrumentos de renta fija) montos nominales involucrados; fechas (de suscripción, inicio, término u otras); precios; tasas; objetivo de la operación; plataforma de negociación; y otros aspectos que se estimen relevantes para la identificación de la respectiva operación, según se establezca en el RO-SIID.
- iv. **Calendario de pagos:** Identificación de los flujos de pago por recibir y flujos de pago por entregar, indicando tasas de interés, montos y fechas asociadas.
- v. **Pagos:** Fechas de pago, monto de pago recibido y monto de pago efectuado.
- vi. **Garantías:** Identificación, tipo de garantía, moneda de valorización, monto, valor de mercado y otros antecedentes de la caución recibida o constituida.
- vii. **Valor de mercado:** Método y moneda de valorización. Valor de mercado neto.

2. Periodicidad de los reportes:

Los Participantes del SIID o sus Agentes Autorizados, según corresponda, deberán reportar la información señalada en el numeral 1 anterior de esta Letra C, dando cumplimiento a las instrucciones y de acuerdo a la periodicidad establecida al efecto en el RO-SIID.

² Legal Entity Identifier

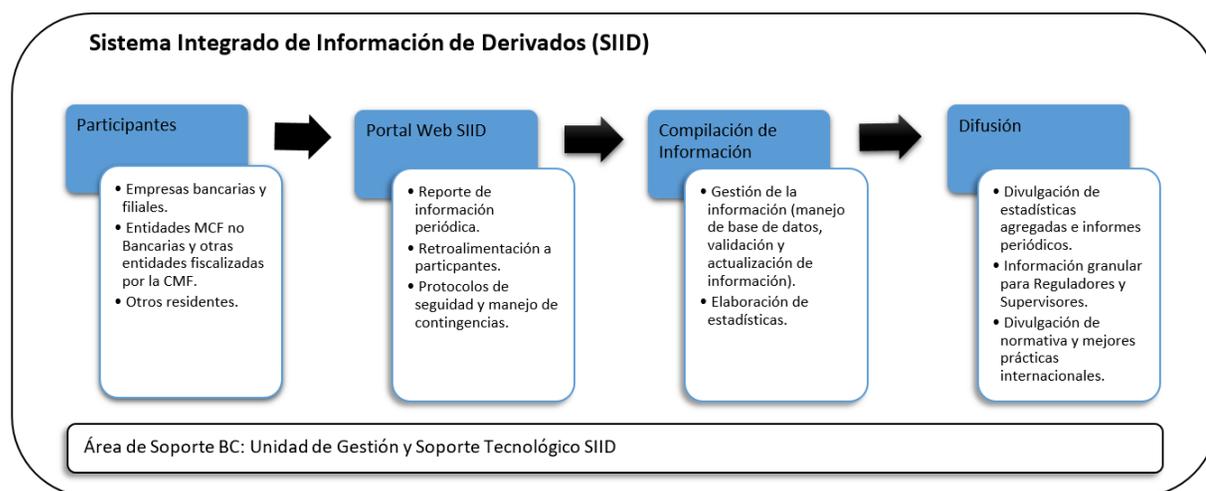


TÍTULO II

Módulos de Administración y Gestión SIID

El Banco Central de Chile, en su calidad de administrador del SIID, dispondrá de un Portal Web, para permitir el funcionamiento de esta Infraestructura del Mercado Financiero: El acceso al Portal Web será directamente en la dirección <https://www.siid.cl> o a través de la página institucional del Banco Central de Chile <http://www.bcentral.cl>.

Diagrama del funcionamiento del Portal Web



En relación a lo señalado en este Título II, la referencia a información a “reguladores y supervisores” comprende exclusivamente al BCCh y a la SBIF y, en su caso, al organismo público que le suceda en el ejercicio de la función de supervisión bancaria.

i. Comunicación para los Participantes del SIID

- Portal Web a través del cual los Participantes del SIID envían electrónicamente la información requerida de acuerdo a lo dispuesto en este Capítulo y el RO-SIID. Este Portal considera procesos de calidad de los datos al ingreso de la información, con retroalimentación a los Participantes, además de mecanismos de seguridad para garantizar la confidencialidad, integridad y acceso a esta información, durante la transmisión de datos y su posterior almacenamiento y registro.
- El SIID considera procesos y planes de contingencia para sus Participantes con el fin de asegurar su continuidad operacional. Asimismo, dispone de un área de Gestión y Soporte Tecnológico.

ii. Compilación de la información

- Procesamiento de la información proporcionada por los Participantes, lo que incluye las etapas de gestión de base de microdatos, recopilación, conciliación, agregación de datos y la elaboración de estadísticas e informes.
- Seguimiento de estándares internacionales, especialmente en materia de requerimientos y estandarización de la información.



iii. **Difusión de información agregada al Público y acceso a Supervisores**

- La información recibida se distribuye al público a través de una sección especializada de este Portal y de uso exclusivo para estos propósitos.

Esta plataforma entregará información agregada al público general y de carácter desagregado (granular) para los supervisores financieros, de acuerdo a sus respectivas atribuciones legales.

iv. **Área de Gestión y Soporte Tecnológico del Banco Central de Chile**

- Esta Unidad es responsable de relacionarse y gestionar las necesidades que surjan en la interacción con los Participantes del SIID.

Dará el soporte tecnológico necesario para la continuidad operativa del SIID. Coordinará el acceso seguro a la información de los Participantes así como de los reguladores y supervisores, en función de las atribuciones legales de cada uno de estos.

- Fomentará la aplicación de mejores prácticas siguiendo estándares y recomendaciones internacionales.



TÍTULO III

Fiscalización

1. Conforme a lo establecido en el artículo 82 de la LOC, corresponderá a la Superintendencia de Bancos e Instituciones Financieras (SBIF) supervigilar el cumplimiento del presente Capítulo por parte de las empresas bancarias, incluidas sus filiales a que se refiere el artículo 70 letra a) de la LGB, en lo que corresponda; y por las demás entidades sujetas a la fiscalización de dicho organismo.

Cabe consignar que la SBIF, en virtud de las atribuciones que le confieren dichos preceptos legales, en relación con lo dispuesto en el artículo 12 de la LGB, se encuentra legalmente facultada para dictar las instrucciones que estime necesarias para implementar las disposiciones contenidas en el presente Capítulo y fiscalizar su cumplimiento.

Asimismo, se deja expresa constancia que lo dispuesto en el presente Capítulo y su RO no incide en modo alguno en las facultades de la SBIF para requerir directamente a las instituciones que supervisa información sobre sus operaciones con derivados, según lo estime necesario para el cumplimiento de sus funciones de fiscalización. En ejercicio de dichas potestades, la SBIF contará además con acceso directo a la información contenida en el SIID y, en su caso, podrá disponer que la información adicional sobre derivados que requiera a sus entidades fiscalizadas le sea remitida a través del SIID, quedando sujeta a la revisión y validación que corresponda.

2. Adicionalmente, el BCCh de acuerdo con el precitado artículo 82 de la LOC, puede supervigilar directamente el cumplimiento de este Capítulo en materias cambiarias, lo cual comprende tanto a los participantes bancarios como no bancarios del SIID.

TÍTULO IV

Autorizaciones

Se faculta al Gerente General del BCCh, o a quién lo subrogue, para:

- i) Dictar el RO-SIID e incorporar al mismo las adecuaciones que se estimen necesarias para el adecuado funcionamiento, seguridad y actualización del SIID.
- ii) Dictar las resoluciones y suscribir los documentos, actos y contratos que fueren necesarios para la aplicación del presente Capítulo.

La Gerencia de Información de Estadísticas, perteneciente a la División de Estadísticas del BCCh gestionará directamente la actualización del RO-SIID que resulte necesaria y comunicará al Gerente General del Banco las eventuales modificaciones que puedan resultar necesarias para su aprobación.



NORMAS TRANSITORIAS

El presente Capítulo regirá una vez transcurrido el plazo de 18 meses contado desde la publicación en el Diario Oficial, oportunidad a contar de la cual su observancia, y la del RO-SIID, será obligatoria para los Participantes del SIID.

El BCCh comunicará mediante resolución del Gerente General, el día en que el SIID iniciará su funcionamiento y puesta en marcha, una vez transcurrido el plazo señalado.

A partir del inicio del funcionamiento del SIID, se dispondrá de un período de marcha blanca que se extenderá por 6 meses adicionales, para que los Participantes y sus Agentes Autorizados, efectúen reportes de prueba al SIID, y que el BCCh pueda verificar la adecuada conexión y comunicación de los mismos para estos efectos, así como la integridad de la información que se remita por esta vía.

En tanto no comience a operar el SIID en un régimen definitivo, respecto de operaciones de derivados cambiarios, se mantendrá vigente la actual normativa del Capítulo IX del Compendio de Cambios Internacionales y su Manual de Información y Formularios.



REGLAMENTO OPERATIVO DEL SISTEMA INTEGRADO DE INFORMACIÓN SOBRE TRANSACCIONES DE DERIVADOS

El presente Reglamento Operativo (“RO-SIID” o “RO”) dispone las instrucciones aplicables a las operaciones de derivados que se deben reportar al Sistema Integrado de Información sobre transacciones de Derivados (“SIID”), administrado por el Banco Central de Chile (“BCCh” o el “Banco”), todo ello de conformidad a lo dispuesto en el Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras (“CNF”).

Las entidades obligadas a reportar al SIID (denominadas en conjunto “Participantes” o “Participantes del SIID” o “Usuarios”), corresponden a las señaladas en el numeral 1 de la Letra B) del Título I del citado Capítulo III.D.3. Esto es, Empresas bancarias y filiales, Entidades MCF no bancarias, Entidades fiscalizadas CMF y Otros domiciliados o residentes en Chile.

La información requerida para fines de cumplir con las exigencias de información previstas en el referido Capítulo III.D.3 y el presente RO deberá ser debidamente reportada por los Participantes, en forma directa o a través de sus Agentes Autorizados, a la Gerencia de División Estadísticas del BCCh.

Entidades obligadas y periodicidad general de los reportes:

- Empresas bancarias y sus filiales a que se refiere el artículo 70 letra a) de la Ley General de Bancos (LGB), en adelante referidas conjuntamente como “Empresas Bancarias”:

Las Empresas bancarias deberán reportar diariamente y sus filiales mensualmente, al Banco las operaciones de derivados que pacten sobre monedas (incluida la Unidad de Fomento), tasa de interés y renta fija con personas domiciliadas o residentes en Chile o en el exterior, sea que dicha información revista o no el carácter de información cambiaria.

La citada información de las empresas bancarias deberá ser confirmada o actualizada mensualmente para cada uno de los contratos de derivados (“Contrato” o “Contratos”) vigentes al cierre de cada mes y complementada con su valor a precio de mercado, junto al detalle de las garantías involucradas en las operaciones en el caso de haberlas. Asimismo, deberán reportar los pagos efectuados durante el mes inmediatamente anterior, ya sea por intercambios de flujos, primas, garantías, compensaciones o término de Contratos.

Asimismo, la Superintendencia de Bancos e Instituciones Financieras (SBIF) podrá solicitar información adicional o a nivel de cartera de instrumentos financieros derivados respecto de sus entidades fiscalizadas o filiales a que se refiere el artículo 70 letra a) de la LGB, quedando sujeta ésta a la revisión y validación que corresponda, por parte de esa Superintendencia.

- Entidades MCF no bancarias y otras Entidades fiscalizadas por la CMF:

Deberán reportar mensualmente al Banco las operaciones de derivados que pacten con personas domiciliadas o residentes en el exterior, así como las operaciones de derivados sobre monedas extranjeras (FX) contratadas en el mercado local, en el carácter de información cambiaria.



- Otros Domiciliados o residentes en Chile:

Deberán reportar mensualmente al Banco las operaciones de derivados sobre monedas, tasas de interés o renta fija que pacten con personas domiciliadas o residentes en el exterior, en el carácter de información cambiaria.

Participantes del SIID	Contraparte	Monedas		Tasa de interés	Renta fija
		FX	\$/UF		
Empresas bancarias y sus filiales	Empresas bancarias y sus filiales	□□	□□	□□	□□
	Entidades MCF no bancarias y otras entidades fiscalizadas por la CMF	□□	□□	□□	□□
	Otros domiciliados o residentes en Chile	□□	□□	□□	□□
	Personas naturales o jurídicas establecidas en el exterior	□□	□□	□□	□□
Entidades MCF no bancarias y otras entidades fiscalizadas por la CMF	Empresas bancarias y sus filiales	□□			
	Entidades MCF no bancarias y otras entidades fiscalizadas por la CMF	□□	-	-	-
	Otros domiciliados o residentes en Chile	□□	-	-	-
	Personas naturales o jurídicas establecidas en el exterior	□□	□□	□□	□□
Otros domiciliados o residentes en Chile	Otros domiciliados o residentes en Chile	-	-	-	-
	Personas naturales o jurídicas establecidas en el exterior	□□	□□	□□	□□

Las obligaciones de reporte señaladas en este RO-SIID deberán ser cumplidas a través del Portal Web del SIID, www.siid.cl, para lo cual el respectivo Participante o su Agente Autorizado definido en el Capítulo III.D.3 del CNF, según corresponda, deberá solicitar al Banco una clave de acceso.

El Participante será responsable exclusivo de la información que se reporte a través del citado Portal Web, debiendo responder por la veracidad de la misma, sea que ella fuere reportada por sus empleados, contratistas o Agente Autorizado, a quienes le haya otorgado dicha clave de acceso.

Los Anexos 1 al 3 contienen las especificaciones de la información requerida, en el Anexo N° 4 se detallan las tablas de codificación y en el Anexo N° 5 se dispone el modelo de solicitud de acceso que deberán suscribir los Participantes para remitir la información requerida al SIID, de conformidad con lo establecido en el Capítulo III.D.3 mencionado y el RO-SIID.

En todo caso, se deja constancia que los Participantes que no correspondan a Empresas bancarias, Entidades MCF no bancarias y Entidades fiscalizadas CMF, podrán optar por informar sus operaciones de derivados siguiendo el proceso de obtención de la clave de acceso entregada por parte del BCCh para reportar, a través de su sitio web, la información cambiaria



que este último solicita conforme a lo establecido en los Capítulos II y IX del Compendio de Normas de Cambios Internacionales del BCCh (CNCI) y su Manual de Procedimientos y Formularios de Información. En estas situaciones y para este sólo efecto, dichos Participantes no requerirán suscribir la solicitud de acceso señalada en el Anexo N° 5. La información de los citados Capítulos del CNCI que sea reportada de esta forma, será internamente procesada por el BCCh para su consolidación en el SIID.

Dependiendo del activo subyacente sobre el que se pacte el respectivo Contrato, los Usuarios deberán enviar al BCCh, a través del referido Portal Web, la información que se indica a continuación:

1. Monedas

Nuevas Operaciones

Para las operaciones de derivados, cuyo activo subyacente corresponda a monedas (incluidas monedas extranjeras, el peso chileno y la “Unidad de Fomento” como unidad de reajuste autorizada respecto de obligaciones pagaderas en moneda corriente), se deberá enviar la información requerida en la Sección A del Anexo N°1 de este RO.

Modificaciones de Contratos

Las modificaciones a los Contratos vigentes, se deberán reportar de acuerdo a lo establecido en las instrucciones de la Sección A del Anexo N°1 de este RO.

Contratos Vigentes

Se deberá enviar mensualmente el detalle de las condiciones financieras de los Contratos vigentes al cierre de cada mes, considerando la información solicitada sobre su valorización a precios de mercado, el detalle de las garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior, según lo indicado en la Sección B del Anexo N°1 de este RO.

Contratos Vencidos

Se deberá reportar mensualmente el detalle de los Contratos vencidos, terminados o ejecutados durante el transcurso del mes inmediatamente anterior, según lo indicado en la Sección B del Anexo N°1 de este RO, sin perjuicio del reporte referido a la terminación de un Contrato conforme a la letra A de ese mismo Anexo.

Periodicidad y plazos para reportar

Las Empresas bancarias deberán proporcionar diariamente, la información solicitada el día hábil bancario siguiente al de las Nuevas Operaciones o Modificaciones de un Contrato, hasta las 10:00 AM horas de ese día. Adicionalmente, deberán enviar dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, la información de Contratos Vigentes y Contratos Vencidos del mes inmediatamente anterior.

Por su parte, las Entidades MCF no bancarias, las Entidades fiscalizadas CMF y otros domiciliados o residentes en Chile deberán reportar mensualmente la información requerida en el Anexo N°1 de este RO, dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, respecto a Nuevas Operaciones, Contratos Vigentes y Contratos Vencidos del mes inmediatamente anterior.

2. Tasa de Interés

Nuevas Operaciones

Para las operaciones de derivados, cuyo activo subyacente corresponda a tasas de interés, se deberá reportar la información requerida en la Sección A del Anexo N°2 de este RO.



Modificaciones de Contratos

Las modificaciones a los Contratos vigentes, se deberán reportar de acuerdo a lo establecido en las instrucciones de la Sección A del Anexo N°2 de este RO.

Contratos Vigentes

Se deberá reportar mensualmente el detalle de las condiciones financieras de los Contratos vigentes al cierre de cada mes, considerando la información solicitada sobre su valorización a precios de mercado, el detalle de las garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior, según lo indicado en la Sección B del Anexo N°2 de este RO.

Contratos Vencidos

Se deberá reportar mensualmente el detalle de los Contratos vencidos, terminados o ejecutados en el transcurso del mes inmediatamente anterior, según lo indicado en la Sección B del Anexo N°2 de este RO, sin perjuicio del reporte referido a la terminación de un Contrato conforme a la letra A de ese mismo Anexo.

Periodicidad y plazos para reportar

Las Empresas bancarias deberán proporcionar diariamente, la información solicitada el día hábil bancario siguiente al de las Nuevas Operaciones o Modificaciones de un Contrato, hasta las 10:00 AM horas. Adicionalmente, deberán reportar dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, la información de Contratos Vigentes y Contratos Vencidos del mes inmediatamente anterior.

Por su parte, las Entidades MCF no bancarias, las Entidades fiscalizadas CMF y otros domiciliados o residentes en Chile deberán reportar mensualmente la información requerida en el Anexo N°2 de este RO, dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, respecto a Nuevas Operaciones, los Contratos Vigentes y Contratos Vencidos del mes inmediatamente anterior.

3. Renta Fija

Nuevas Operaciones

Para las operaciones de derivados, cuyo activo subyacente corresponda a renta fija, se deberá reportar la información requerida en la Sección A del Anexo N°3 de este RO.

Modificaciones de Contratos

Las modificaciones a los Contratos vigentes, se deberán reportar de acuerdo a lo establecido en las instrucciones de la Sección A del Anexo N°3 de este RO.

Contratos Vigentes

Se deberá reportar mensualmente el detalle de las condiciones financieras de los Contratos vigentes al cierre de cada mes, considerando la información solicitada sobre su valorización a precio de mercado, el detalle de las garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior, según lo indicado en la Sección B del Anexo N°3 de este RO.

Contratos Vencidos

Se deberá reportar mensualmente el detalle de los Contratos vencidos, terminados o ejecutados en el transcurso del mes inmediatamente anterior, según lo indicado en la Sección B del Anexo N°3 de este RO, sin perjuicio del reporte referido a la terminación de un Contrato conforme a la letra A de ese mismo Anexo.



Periodicidad y plazos para reportar

Las Empresas bancarias deberán proporcionar diariamente, la información solicitada el día hábil bancario siguiente al de las Nuevas Operaciones o Modificaciones de un Contrato, hasta las 10:00 AM horas. Adicionalmente, deberán reportar dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, la información de Contratos Vigentes y Contratos Vencidos del mes inmediatamente anterior.

Por su parte, las Entidades MCF no bancarias, las Entidades fiscalizadas CMF y Otros domiciliados o residentes en Chile deberán reportar mensualmente la información requerida en el Anexo N°3 de este RO, dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, respecto a Nuevas Operaciones, los Contratos Vigentes y Contratos Vencidos del mes inmediatamente anterior.

Conforme a lo expresado, el Participante o Usuario tiene presente que la información que proporcione al Banco sobre contratos de derivados, en forma electrónica a través del SIID, será entregada bajo juramento, en cuanto a que los datos contenidos en los reportes que remita al BCCh corresponderán en forma fidedigna y exacta a las operaciones que el Participante informe en cada caso, debiendo precisar además si los antecedentes que conforman el respectivo reporte dicen o no relación con el cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI.

Al respecto, tratándose de información cambiaria, el Participante deja constancia expresa que estos antecedentes los proporcionará al Banco Central de Chile para dar cumplimiento a las normas contempladas en los Capítulos citados del CNCI, establecidas por el BCCh conforme a lo dispuesto en el Párrafo Octavo del Título III de su LOC, las que el Participante declara conocer, asumiendo la responsabilidad que se establece en la normativa legal antedicha.



ANEXO N°1

ESPECIFICACIONES DE LA INFORMACIÓN REQUERIDA RESPECTO DE “OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS SOBRE MONEDAS”

I. INSTRUCCIONES GENERALES:

La información requerida de conformidad con este Anexo deberá ser considerada por los Usuarios, para reportar las operaciones con instrumentos derivados cuyo activo subyacente corresponda a monedas. Para ello se deberá enviar la información solicitada en este Anexo a la Gerencia de División Estadísticas del BCCh a través del Portal Web del SIID (www.siid.cl).

Las Empresas bancarias deberán reportar hasta las 10:00 AM horas del día hábil bancario siguiente las Nuevas Operaciones y Modificaciones efectuadas a los Contratos. Adicionalmente, deberán informar dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, los antecedentes de los Contratos Vigentes y Contratos Vencidos del mes inmediatamente anterior, de acuerdo a las instrucciones contenidas en las diferentes secciones de las Especificaciones contenidas en este Anexo.

Los demás Usuarios que no correspondan a Empresas bancarias, deberán reportar mensualmente la información de sus Nuevas Operaciones y Modificaciones de Contratos dentro de los cinco primeros días hábiles bancarios del mes siguiente de efectuadas, así como los antecedentes de los Contratos Vigentes y Contratos Vencidos.

SECCIÓN A: Información Diaria de Nuevas Operaciones, Modificaciones y Términos.

1) Nuevas Operaciones

Para reportar las nuevas operaciones pactadas por los Usuarios, estos deberán enviar al Banco los campos pertenecientes a la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, indicando en el campo “Evento de Reporte” alguno de los eventos detallados en el numeral “2.1 Suscripción”.

2) Modificaciones de Contratos

Los Usuarios que efectúen modificaciones a sus Contratos, deberán reportar todos los campos previamente reportados actualizados, indicando como “Evento de Reporte” alguno de los señalados en el numeral “2.2 Modificación”.

Los campos “RUT Usuario (Contraparte 1)”, “LEI Contraparte 1”, “Identificador del Contrato”, “Identificador de Operaciones Estructuradas” y “Fecha y hora de suscripción del Contrato” son los que permitirán identificar la operación previamente informada sobre la cual se aplicará la modificación o el término anticipado. Debido a lo anterior, dichos campos no podrán ser modificados por los Usuarios.

3) Términos Anticipados y Anulaciones de Contratos

En el caso de los Usuarios que transfieran a un tercero el Contrato previamente reportado o pongan término a este en una fecha anterior a lo inicialmente establecido, deberán enviar al Banco la información que aplica a los eventos de reporte “2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación”, “2.3.2 Cesión” o “2.3.3 Anulación”, según corresponda.



SECCIÓN B: Información Mensual de Contratos Vigentes y Contratos Terminados

1) Contratos Vigentes

Los Usuarios deberán reportar, respecto de cada Contrato Vigente al término del mes calendario, la última información disponible para los campos de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación” además de los pertenecientes a las Secciones 2 “Pagos”, 3 “Garantías” y 4 “Valor de Mercado”, indicando como “Evento de Reporte” la opción “2.4 Vigencia”.

La información de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación” será entendida como una confirmación sobre las condiciones vigentes del derivado al cierre del mes informado.

La información de la Sección 2 “Pagos” hará referencia a cualquier pago o intercambio de flujos originado por la operación en cuestión, efectuado durante el transcurso del mes informado.

La información de las Secciones 3 “Garantías” y 4 “Valor de Mercado” deberá ser reportada indicando las condiciones vigentes al cierre del mes informado.

2) Contratos Terminados

Los Usuarios deberán reportar, para cada Contrato Terminado indicando como “Evento de Reporte” la opción “2.3.4 Vencimiento”, la información vigente al momento del término de éste, completando la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, además de la Sección 2 “Pagos”.

Se deberán incluir también mensualmente en este Evento de Reporte aquellos Contratos que fueron terminados por “2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación” o “2.3.2 Cesión”.

La información de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, será entendida como una confirmación sobre las condiciones vigentes del derivado al momento de su término.

La información reportada en la Sección 2 “Pagos”, hará referencia a cualquier pago o intercambio de flujos originados por el término de la operación en cuestión.

En la información que se proporcione bajo juramento, referida a Contratos sobre monedas, se precisará si dichos antecedentes dicen relación con el cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI.

II.INFORMACIÓN SOLICITADA

Sección 1: Condiciones Financieras de la Operación

N° Campo	Campo	Descripción original
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 II y IX del CNCI, sobre operaciones con instrumentos derivados.



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>Deberán ser informados diariamente los registros indicados a continuación.</p> <p>2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Usuario.</p> <p>2.1.2 Adquisición por cesión: Cuando el Usuario 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 Usuario.</p> <p>Deberán ser informados diariamente los registros indicados a continuación.</p> <p>2.2.1 Recouponing: Modificación de las condiciones financieras de un Contrato a consecuencia de pagos que hacen las partes con el objeto de modificar su valor razonable (mark to market).</p> <p>2.2.2 Modificación de contraparte por cesión: El Usuario 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, que no corresponde a una corrección de reporte, a alguna de las condiciones financieras del Contrato, 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, cambios en las partes compradora o vendedora por causales distintas de cesión, etc.</p> <p>2.2.4 Corrección de reporte: Rectificación de información enviada previamente por el Usuario 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 Usuario, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.</p> <p>Deberán ser informados diariamente los registros indicados a continuación.</p> <p>2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación: Caducidad o término de forma anticipada del Contrato de derivado 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 Usuario (cedente).</p> <p>2.3.3 Anulación: Eliminación de Contratos informados previamente, debido a que estos nunca existieron (ej. duplicaciones, cotizaciones, error de información, entre otros) o bien no estaban afectos a la regulación de derivados de monedas del Capítulo III.D.3 del CNF y su respectivo Reglamento Operativo.</p> <p>Deberán ser informados mensualmente los registros indicados a continuación.</p> <p>2.3.4 Vencimiento: Término de las obligaciones que emanan de una operación conforme al plazo establecido en el Contrato previamente informado. Adicionalmente, respecto de los eventos 2.3.1., 2.3.2 y 2.3.3 también deberán proporcionar al cierre del mes respectivo la información de las condiciones financieras vigentes para cuando se puso término a los Contratos.</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. Esto deberá ser enviado mensualmente, junto a la información de valorización del Contrato y sus garantías.</p>
3	RUT Usuario (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).
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.
5	RUT Contraparte del Usuario (Contraparte 2)	RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

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.
7	Nombre o Razón Social Contraparte 2	Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.
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.
9	RUT de Entidad de Contraparte Central	RUT (Rol único Tributario) de la Entidad de 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.
10	LEI de Entidad de Contraparte Central	Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>), si lo tuviere, asignado a la Entidad de Entidad de Contraparte Central a través de la cual se haya convenido realizar la liquidación de las obligaciones correspondientes al Contrato.
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 Entidad de Contraparte Central.
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.
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.
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
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.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

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 producto de liquidaciones en cámara de Contraparte Central no se incluyen en este campo.
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 producto de liquidaciones en cámara de Contraparte central no se incluyen en este campo.
18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Usuario 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.
19	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. Por lo que es necesario 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.
20	Instrumento	Tipo de instrumento al que corresponde la operación informada, según la Tabla de Instrumentos.
21	Opciones: Clase	Clase de opción a que corresponde la operación informada, según la modalidad de ejercicio pactada en el Contrato; de acuerdo a lo señalado en la Tabla Clase de Opción



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

22	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 Opciones – Posición en la Operación.
23	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, considerando para tal efecto la Tabla de Instrumentos.
24	Modalidad de Liquidación	Modalidad estipulada en el Contrato para llevar a cabo los pagos o liquidaciones que éste origine, la cual puede ser por compensación o entrega física, según lo señalado en la Tabla Modalidad de Liquidación.
25	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.
26	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.
27	Monto de Moneda Comprada	Monto de la moneda subyacente a recibir por la Contraparte 1 al término de la operación.
28	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
29	Monto de Moneda Vendida	Monto de la moneda subyacente a entregar por la Contraparte 1 en cada fecha de pago o al término de la operación.
30	Tipo de Tasa de Interés a recibir	Indicar si la tasa de interés recibida por la Contraparte 1 es fija o variable. Si es variable, reportar el código de la tasa de interés, según lo señalado en la Tabla de Tasas de Interés.
31	Tipo de Tasa de Interés a entregar	Indicar si la tasa de interés entregada por la Contraparte 1 es fija o variable. Si es variable, reportar el código de la tasa de interés, según lo señalado en la Tabla de tasas de Interés.
32	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Usuario 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.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

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.
34	Fecha <i>fixing</i> 1	Fecha en la cual se determina el tipo de cambio de referencia para aquellas operaciones que se liquidan por compensación. 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.
35	Fecha <i>fixing</i> 2	Fecha final del período a considerar en el <i>fixing</i> de una operación "asiática", o bien la última en la cual podrá ser ejercido el derecho de una operación "americana" o "bermuda".
36	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 de término o liquidación anticipada".
37	Fecha de Pago de la operación	Fecha de la última liquidación de la operación.
38	Fecha de inicio de la Modificación	Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una modificación.
39	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 de las monedas involucradas, según norma ISO 4217, separados por el signo "/" (por ejemplo pesos chilenos por un dólar de Estados Unidos de América se indicaría CLP/USD).
40	Precio Pactado a 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 <i>Precio Strike</i> . 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.
41	Puntos Forward	Diferencia entre el Precio Pactado a Futuro y el Precio Spot considerado en la negociación.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

42	Moneda de Prima/Pago inicial	<p>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.</p> <p>En el caso de una cesión, si el Usuario (Contraparte 1) ha entregado o recibido un pago debe indicar la moneda de este.</p> <p>Se debe indicar el código de la moneda, según norma ISO 4217.</p>
43	Monto Prima/Pago Inicial Recibida(o)	Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.
44	Monto Prima/Pago Inicial Entregada(o)	Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.
45	Precio Barrera de Entrada (<i>Knock-in</i>)	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción podrá ser ejercida.
46	Precio Barrera de Salida (<i>Knock-out</i>)	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción no podrá ser ejercida.
47	Objetivo de la Operación	<p>Indicar el objetivo de la operación para la Contraparte 1, según lo indicado en la Tabla de Objetivo de la Operación.</p> <p>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.</p>
48	Convenio Marco	Indicar Tipo y código único asignado al Convenio Marco, si correspondiere, bajo el cual fue negociada la operación, según Tabla de Convenio Marco de contratación de operaciones con productos derivados.
49	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.
50	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.
51	Cláusula de <i>Recouponing</i>	Indicar si la operación considera o no cláusula de <i>Recouponing</i> en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de <i>Recouponing</i> .



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

52	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.
53	Fecha de Término o Liquidación Anticipada	Fecha acordada para realizar la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.
54	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.
55	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".
56	RUT Intermediario	RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario (Broker) que actuó como intermediario en el cierre de la operación.
57	LEI Intermediario	Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>), si lo tuviere, del Broker que actuó como intermediario en el cierre de la operación.
58	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.
59	Número del Flujo a Recibir	Correlativo del número del flujo a recibir a futuro por la Contraparte 1, ya sea por intercambio del principal o pago de intereses.
60	Spread sobre Tasa de Interés Variable a Recibir	Spread que recibe la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable.
61	Tasa de Interés Fija a Recibir	Tasa de interés fija a recibir por la Contraparte 1.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

62	Fecha de <i>Fixing</i> para Tasa de Interés a Recibir	Fecha en la cual se fijan o determinan los valores de las tasas variables que se consideran para el cálculo de intereses del flujo a recibir por la Contraparte 1.
63	Fecha de Inicio del Flujo a Recibir	Fecha de inicio del período durante el cual se devengarán los intereses del flujo a recibir por la Contraparte 1.
64	Fecha de Término del Flujo a Recibir	Fecha de término del período durante el cual se devengarán intereses para el flujo que será recibido por la Contraparte 1.
65	Monto Nocional Aplicable al Flujo a Recibir	Monto nocional que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a recibir por la Contraparte 1.
66	Monto a Recibir como Intercambio del Capital	Monto recibido por la Contraparte 1 en el flujo respectivo, producto del intercambio de capital o principal.
67	Moneda del Monto a Recibir como Intercambio de Capital	Código de la moneda del monto a recibir como intercambio de capital o principal, según norma ISO 4217.
68	Número del Flujo a Entregar	Correlativo del número del flujo a entregar a futuro por la Contraparte 1, ya sea por intercambio del principal o pago de intereses.
69	Spread sobre Tasa de Interés Variable a Entregar	Spread bajo el cual se obliga la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable.
70	Tasa de Interés Fija a Entregar	Tasa de interés fija bajo la cual se obliga la Contraparte 1.
71	Fecha de <i>Fixing</i> para Tasa de Interés a Entregar	Fecha en la cual se fijan o determinan los valores de las tasas variables que se consideran para el cálculo de intereses del flujo a entregar por la Contraparte 1.
72	Fecha Inicio del Flujo a Entregar	Fecha de inicio del período de tiempo durante el cual se devengarán los intereses del flujo a entregar por la Contraparte 1.
73	Fecha de Término del Flujo a Entregar	Fecha de término del período de tiempo durante el cual se devengarán intereses para el flujo que será entregado por la Contraparte 1.



74	Monto Nacional Aplicable al Flujo a Entregar	Monto nacional que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a entregar por la Contraparte 1.
75	Monto a Entregar como Intercambio de Capital	Monto entregado por la Contraparte 1 en el flujo respectivo, producto del intercambio de capital o principal.
76	Moneda del Monto a Entregar como Intercambio de Nacional	Código de la moneda del monto a entregar como intercambio de capital o principal, según norma ISO 4217. .

Sección 2: Pagos

N° Campo	Campo	Descripción
77	Fecha de Pago	Fecha de pago o liquidación.
78	Monto Pago Recibido	Monto recibido 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.
79	Monto Pago entregado	Monto pagado por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. En 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.
80	Tipo de Pago Efectuado	Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado.



Sección 3: Garantías

N° Campo	Campo	Descripción
81	Moneda de Valorización de la Garantía	<p>Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N°20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
82	Identificador de la Garantía Recibida	<p>Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas que respaldan el Contrato. En caso de que otras operaciones estén respaldadas por esta misma garantía o portafolio se debe repetir este código para cada una de ellas.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
83	Tipo de Garantía Recibida	<p>Tipo de activo (s) recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 en garantía para caucionar la obligación de la Contraparte 2 en la operación, según Tabla de Activos en Garantías. En el caso de corresponder a más de un activo, indicar el porcentaje que representa cada uno de los activos a valor de mercado o valor razonable al último día hábil del mes que se está informando.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
84	Monto Umbral ("Threshold") para Contraparte 2	<p>Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 2 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de <i>recouponing</i>.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

85	Valor Recibida Garantía	<p>Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas 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.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
86	Identificador de la Garantía Entregada	<p>Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías entregadas que respaldan el Contrato. En caso de que otras operaciones estén respaldadas por esta misma garantía o portafolio se debe repetir este código para cada una de ellas.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
87	Tipo de Garantía Entregada	<p>Tipo de activo (s) entregado(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, según Tabla de Activos en Garantías. En el caso de ser constituido por más de un activo, indicar el porcentaje de cada uno a valor de mercado o valor razonable al último día hábil del mes que se está informando.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
88	Monto Umbral (“ <i>Threshold</i> ”) para Contraparte 1	<p>Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 1 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de <i>recouping</i>.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
89	Valor de Garantía Entregada	<p>Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías entregadas por la Contraparte 1 en caución de las operaciones reportadas, una vez realizado los descuentos pactados aplicables (“<i>haircut</i>”). En el caso que la misma garantía o portafolio de garantías respalden otras operaciones, se debe repetir este valor para cada una de ellas.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>



Sección 4: Valor de Mercado

N° Campo	Campo	Descripción
90	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>) o corresponde a la efectuada por una Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345.
91	Moneda de Valorización	Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.
92	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. 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.
93	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.
94	Opciones: Delta	En este campo se informará, en pesos, el cambio en unidades monetarias que tendría el valor teórico del contrato cuando el precio o tasa de interés del subyacente, según corresponda, varíe en 1% respecto de su valor vigente
95	Opciones: Gamma	En este campo se informará, en pesos, el cambio en unidades monetarias que tendría el valor de “delta” cuando el precio o tasa de interés del subyacente, según corresponda, varíe en 1% respecto de su valor vigente.
96	Opciones: Vega	En este campo se informará, en pesos, el valor de la sensibilidad o cambio de valor teórico de la opción ante una variación de 1% en la volatilidad anualizada del activo subyacente.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

97	Ajustes a la Valorización por Riesgo de Contraparte	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de Contraparte de la operación, para la Contraparte 1.
98	Ajustes a la Valorización por BID-OFFER Spread	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por BID-OFFER Spread de la operación, para la Contraparte 1.
99	Otros Ajustes a la Valorización	Indicar monto de otros ajustes al Valor de Mercado Neto de la operación distintos a los informados en los campos anteriores, para la Contraparte 1.



ANEXO N°2

ESPECIFICACIONES DE LA INFORMACIÓN REQUERIDA DE “OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS SOBRE TASAS DE INTERÉS”

I. INSTRUCCIONES GENERALES:

La información requerida de conformidad con este Anexo deberá ser considerada por los Usuarios para reportar las operaciones con Instrumentos Derivados cuyo activo subyacente corresponda a tasas de interés. Para ello se deberá enviar la información solicitada en este Anexo a la Gerencia de División Estadísticas del BCCh a través del Portal Web del SIID (www.siid.cl).

Las Empresas bancarias deberán reportar hasta las 10:00 AM horas del día hábil bancario siguiente las Nuevas Operaciones y Modificaciones efectuadas a los Contratos. Adicionalmente, deberán enviar dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, los antecedentes de los Contratos Vigentes y Contratos Vencidos del mes inmediatamente anterior, de acuerdo a las instrucciones contenidas en las diferentes secciones de las Especificaciones contenidas en este Anexo.

Los demás Usuarios que no correspondan a Empresas bancarias, deberán reportar mensualmente la información de sus Nuevas Operaciones y Modificaciones dentro de los cinco primeros días hábiles bancarios del mes siguiente de efectuadas, así como los antecedentes de los Contratos Vigentes y Contratos Vencidos.

SECCIÓN A: Información Diaria de Nuevas Operaciones, Modificaciones y Términos.

1) Nuevas Operaciones

Para reportar las nuevas operaciones pactadas por los Usuarios, estos deberán enviar al Banco los campos pertenecientes a la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, indicando en el campo “Evento de Reporte” alguno de los eventos detallados en el numeral “2.1 Suscripción”.

2) Modificaciones de los Contratos

Los Usuarios que efectúen modificaciones a sus Contratos, deberán enviar todos los campos previamente reportados actualizados, indicando como “Evento de Reporte” alguno de los señalados en el número “2.2 Modificación”.

Los campos “RUT Usuario (Contraparte 1)”, “LEI Contraparte 1”, “Identificador del Contrato”, “Identificador de Operaciones Estructuradas” y “Fecha y hora de suscripción del Contrato” son los que permitirán identificar la operación previamente informada sobre la cual se aplicará la modificación o el término anticipado. Debido a lo anterior, dichos campos no podrán ser modificados por los Usuarios.

3) Términos Anticipados y Anulaciones de Contratos

En el caso de los Usuarios que transfieran a un tercero el Contrato previamente reportado o pongan término a este en una fecha anterior a lo inicialmente establecido, deberán reportar al Banco la información que aplica a los eventos de reporte “2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación”, “2.3.2 Cesión” o “2.3.3 Anulación”, según corresponda.



SECCIÓN B: Información Mensual de Contratos Vigentes y Contratos Terminados

1) Contratos Vigentes

Los Usuarios deberán reportar, respecto de cada Contrato Vigente al término del mes calendario, la última información disponible para los campos de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, además de los pertenecientes a las secciones 2 “Pagos”, 3 “Garantías” y 4 “Valor de Mercado”, indicando como “Evento de Reporte” la opción “2.4 Vigencia”.

La información de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación” será entendida como una confirmación sobre las condiciones vigentes del derivado al cierre del mes informado.

La información de la Sección 2 “Pagos” hará referencia a cualquier pago o intercambio de flujos originado por la operación en cuestión, efectuado durante el transcurso del mes informado.

La información de las Secciones 3 “Garantías” y 4 “Valor de Mercado” deberá ser reportada indicando las condiciones vigentes al cierre del mes informado.

2) Contratos Terminados

Los Usuarios deberán reportar, para cada Contrato Terminado indicando como “Evento de Reporte” la opción “2.3.4 Vencimiento”, la información vigente al momento del término de éste, completando la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación” además de la Sección 2 “Pagos”.

Se deberán incluir también mensualmente en este Evento de Reporte aquellos Contratos que fueron terminados por “2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación” o “2.3.2 Cesión”.

La información de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, será entendida como una confirmación sobre las condiciones vigentes del derivado al momento de su término.

La información reportada en la Sección 2 “Pagos”, hará referencia a cualquier pago o intercambio de flujos originados por el término de la operación en cuestión.

En la información que se proporcione bajo juramento, referida a Contratos sobre tasas de interés, se precisará si dichos antecedentes dicen relación con el cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI.

II. INFORMACIÓN SOLICITADA

Sección 1: Condiciones Financieras de la Operación

Nº Campo	Campo	Descripción original
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 II y IX del CNCI, sobre operaciones con instrumentos derivados.



2	Evento Reporte de	<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>Deberán ser reportados diariamente los registros indicados a continuación.</p> <p>2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Usuario.</p> <p>2.1.2 Adquisición por cesión: Cuando el Usuario 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 Usuario.</p> <p>Deberán ser reportados diariamente los registros indicados a continuación.</p> <p>2.2.1 <i>Recouping</i>: Modificación de las condiciones financieras de un Contrato a consecuencia de pagos que hacen las partes con el objeto de modificar su valor razonable (<i>mark to market</i>).</p> <p>2.2.2 Modificación de contraparte por cesión: El Usuario 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, que no corresponde a una corrección de reporte, a alguna de las condiciones financieras del Contrato, 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, cambios en las partes compradora o vendedora por causales distintas de cesión (ej. fusión) etc.</p> <p>2.2.4 Corrección de reporte: Rectificación de información enviada previamente por el Usuario 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 Usuario, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.</p> <p>Deberán ser informados diariamente los registros indicados a continuación.</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 Usuario (cedente).</p> <p>2.3.3 Anulación: Eliminación de Contratos informados previamente, debido a que estos Contratos nunca existieron (ej. duplicaciones, cotizaciones, entre otros) o bien no estaban afectos a la regulación de derivados de tasas del III.D.3 del CNF y su respectivo Reglamento Operativo.</p> <p>Deberán ser informados mensualmente los registros indicados a continuación.</p> <p>2.3.4 Vencimiento: Término de las obligaciones que emanan de una operación conforme al plazo establecido en el Contrato previamente informado. Adicionalmente, respecto de los eventos 2.3.1., 2.3.2 y 2.3.3 también deberán proporcionar al cierre del mes respectivo la información de las condiciones financieras vigentes para cuando se puso término a los Contratos.</p> <p>2.4 Vigencia</p> <p>Corresponde a las condiciones financieras vigentes para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vigentes. Este deberá ser enviado mensualmente, junto a la información de valorización del Contrato y sus garantías.</p>
3	RUT Usuario (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de tasas (Contraparte 1).
4	LEI Contraparte 1	Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de tasas de interés, si lo tuviere.
5	RUT Contraparte del Usuario (Contraparte 2)	RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar (Contraparte 2).



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

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.
7	Nombre o Razón Social Contraparte 2	Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.
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.
9	RUT 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.
10	LEI 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.
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.
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.
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.
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
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



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

16	RUT del Cedente o Cesionario	<p>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.</p> <p>Las novaciones producto de liquidaciones en Cámara de Contraparte Central no se incluyen en este campo.</p>
17	LEI Cedente o Cesionario	<p>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.</p> <p>Las novaciones producto de liquidaciones en Cámara de Contraparte Central no se incluyen en este campo.</p>
18	Identificador del Contrato	<p>Código único asignado por el Usuario 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.</p> <p>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 informar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.</p>
19	Identificador de Operaciones Estructuradas	<p>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. Por lo que es necesario completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato.</p> <p>Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura.</p>
20	Instrumento	<p>Tipo de Instrumento al que corresponda la operación informada según la Tabla de Instrumentos.</p>
21	Opciones: Clase	<p>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.</p>
22	Opciones: Posición en la Operación	<p>Indicar si la Contraparte 1 asume la posición compradora o vendedora en la opción, según lo señalado en la Tabla Opciones – Posición en la Operación.</p>



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

23	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, considerando para tal efecto la Tabla de Instrumentos.
24	Modalidad Liquidación	de	Modalidad estipulada en el Contrato para llevar a cabo los pagos o liquidaciones que éste origine, la cual puede ser por compensación o entrega física, según lo señalado en la Tabla Modalidad de Liquidación.
25	Moneda Compensación	de	Código de la moneda en la cual se realiza la compensación, según norma ISO 4217, en caso de haberse pactado dicha modalidad de liquidación.
26	Moneda Nacional	Monto	Código de la moneda en la que está expresado el monto nacional sobre el cual se calculan los intereses a intercambiar, según norma ISO 4217.
27	Monto nacional		Se debe indicar el monto nacional de la operación, sobre el cual se calculan los intereses. Este campo se debe completar cuando hay un único flujo.
28	Tipo de Tasa de Interés a Recibir	de	Indicar si la tasa de interés recibida por la Contraparte 1 es fija o variable. Si es variable, reportar el código de la tasa de interés, según lo señalado en la Tabla de Tasas de Interés.
29	Tipo de Tasa de Interés a Entregar	de	Indicar si la tasa de interés entregada por la Contraparte 1 es fija o variable. Si es variable, reportar el código de la tasa de interés, según lo señalado en la Tabla de Tasas de Interés.
30	Fecha y Hora de Suscripción del Contrato	de	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Usuario y 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.
31	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.
32	Fecha de <i>Fixing</i>		Fecha en la cual se fijan o determinan los valores de las tasas de interés que se consideran para el cálculo del flujo cuando hay un único intercambio a futuro. En el caso de haber más intercambios se debe indicar la fecha de <i>fixing</i> para cada uno de ellos en la sección de calendario de pagos.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

33	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 de término o liquidación anticipada".
34	Fecha de Pago de la Operación	Fecha de la última liquidación de la operación.
35	Fecha de Inicio de la Modificación	Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una modificación.
36	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> .
37	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.
38	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.
39	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.
40	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 Usuario (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.
41	Monto Prima/Pago Inicial Recibida(o)	Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

42	Monto Prima/Pago Inicial Entregada(o)	Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.
43	Precio Barrera de Entrada (<i>Knock-in</i>)	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual una opción podrá ser ejercida.
44	Precio Barrera de Salida (<i>Knock-out</i>)	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción no podrá ser ejercida.
45	Objetivo de la Operación	Indicar el objetivo de la operación para la Contraparte 1, según lo indicado en la Tabla de 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
46	Convenio Marco	Indicar tipo y código único asignado al Convenio Marco, si correspondiere, bajo el cual fue negociada la operación, según Tabla de Convenio Marco de contratación de operaciones con productos derivados.
47	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.
48	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.
49	Cláusula de <i>Recouping</i>	Indicar si la operación considera o no cláusula de <i>Recouping</i> en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de <i>Recouping</i> .
50	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.
51	Fecha de Término o Liquidación Anticipada	Fecha acordada para realizar la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

52	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.
53	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".
54	RUT Intermediario	RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario Broker que actuó como intermediario en el cierre de la operación.
55	LEI Intermediario	Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>), si lo tuviere, del Broker que actuó como intermediario en el cierre de la operación.
56	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.
57	Número del Flujo a Recibir	Correlativo del número del flujo a recibir a futuro por la Contraparte 1, correspondiente a pago de intereses.
58	Spread sobre Tasa de Interés Variable a Recibir	Spread que recibe la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable.
59	Tasa de Interés Fija a Recibir	Tasa de interés fija a recibir por la Contraparte 1.
60	Fecha de <i>Fixing</i> para Tasa de Interés a Recibir	Fecha en la cual se fijan o determinan los valores de las tasas variables que se consideran para el cálculo de intereses del flujo a recibir por la Contraparte 1.
61	Fecha de Inicio del Flujo a Recibir	Fecha de inicio del período durante el cual se devengarán los intereses del flujo a recibir por la Contraparte 1.
62	Fecha de Término del Flujo a Recibir	Fecha de término del período durante el cual se devengarán intereses para el flujo que será recibido por la Contraparte 1.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

63	Monto Nacional Aplicable al Flujo a Recibir	Monto nocial que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a recibir por la Contraparte 1.
64	Monto a Recibir como Intercambio del Capital	Monto recibido por la Contraparte 1 producto del intercambio del capital o principal.
65	Número del Flujo a Entregar	Correlativo del número del flujo a entregar por la Contraparte 1, correspondiente a pago de intereses.
66	Spread sobre Tasa de Interés Variable a Entregar	Spread que entrega la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable.
67	Tasa de Interés Fija a Entregar	Tasa de interés fija a entregar por la Contraparte 1.
68	Fecha de Fixing para Tasa de Interés a Entregar	Fecha en la cual se fijan o determinan los valores de las tasas variables que se consideran para el cálculo de intereses del flujo a entregar por la Contraparte 1.
69	Fecha Inicio Flujo a Entregar	Fecha de inicio del período durante el cual se devengarán los intereses del flujo a entregar por la Contraparte 1.
70	Fecha de Término del Flujo a Entregar	Fecha de término del período durante el cual se devengarán intereses para el flujo que será entregado por la Contraparte 1.
71	Monto Nacional Aplicable al Flujo a Entregar	Monto nocial que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a entregar por la Contraparte 1.
72	Monto a Entregar como Intercambio del Capital	Monto entregado por la Contraparte 1 producto del intercambio del capital o principal.

Sección 2: Pagos

N° Campo	Campo	Descripción
73	Fecha de Pago	Fecha de pago o liquidación.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

74	Monto Pago Recibido	Monto recibido por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. En 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.
75	Monto Pago Entregado	Monto pagado por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. En 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.
76	Tipo de Pago Efectuado	Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado

Sección 3: Garantías

N° Campo	Campo	Descripción
77	Moneda de Valorización de Garantía	Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217. En caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.
78	Identificador de la Garantía Recibida	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas que respaldan el Contrato de derivado. En caso de que otras operaciones estén respaldadas por esta misma garantía o portafolio se debe repetir este código 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.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

79	Tipo de Garantía Recibida	<p>Tipo de activo (s) recibido(s) por la Contraparte 1 en garantía para caucionar la obligación de la Contraparte 2 en la operación, según Tabla Tipo de Activos en Garantías. En el caso de corresponder a más de un activo, indicar el porcentaje que representa cada uno de los activos a valor de mercado o valor razonable al último día hábil del mes que se está informando.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
80	Monto Umbral ("Threshold") para Contraparte 2	<p>Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 2 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de <i>recouping</i>.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
81	Valor Garantía Recibida	<p>Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas 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.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
82	Identificador de la Garantía Entregada	<p>Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías entregadas que respaldan el Contrato de derivado. En caso de que otras operaciones estén respaldadas por esta misma garantía o portafolio se debe repetir este código para cada una de ellas.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
83	Tipo de Garantía Entregada	<p>Tipo de activo (s) entregado(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, según Tabla Tipo de Activos en Garantías. En el caso de ser constituido por más de un activo, indicar el porcentaje de cada uno a valor de mercado o valor razonable al último día hábil del mes que se está informando.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>



84	Monto Umbral ("Threshold") para Contraparte 1	<p>Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 1 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de <i>recouponing</i>.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
85	Valor de Garantía Entregada	<p>Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías constituidas por la Contraparte 1 en caución de las operaciones reportadas, una vez realizado los descuentos pactados aplicables ("<i>haircut</i>"). En el caso que la misma garantía o portafolio de garantías respalden otras operaciones, se debe repetir este valor para cada una de ellas.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>

Sección 4: Valor de Mercado

N° Campo	Campo	Descripción
86	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>) o corresponde a la efectuada por una Entidad de Contraparte Central.
87	Moneda de Valorización	Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.
88	Valor de Mercado	<p>Valor de mercado o valor razonable neto del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando.</p> <p>En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen.</p> <p>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.</p>
89	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.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

90	Opciones: Delta	En este campo se informará, en pesos, el cambio en unidades monetarias que tendría el valor teórico del contrato cuando el precio o tasa de interés del subyacente, según corresponda, varíe en 1% respecto de su valor vigente
91	Opciones: Gamma	En este campo se informará, en pesos, el cambio en unidades monetarias que tendría el valor de “delta” cuando el precio o tasa de interés del subyacente, según corresponda, varíe en 1% respecto de su valor vigente.
92	Opciones: Vega	En este campo se informará, en pesos, el valor de la sensibilidad o cambio de valor teórico de la opción ante una variación de 1% en la volatilidad anualizada del activo subyacente.
93	Ajustes a la valorización por Riesgo de Contraparte	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de Contraparte de la operación, para la Contraparte 1.
94	Ajustes a la Valorización por BID-OFFER Spread	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por BID-OFFER Spread de la operación, para la Contraparte 1.
95	Otros Ajustes a la Valorización	Indicar monto de otros ajustes al Valor de Mercado Neto de la operación distintos a los informados en los campos anteriores, para la Contraparte 1.



ANEXO N°3

ESPECIFICACIONES DE LA INFORMACIÓN REQUERIDA DE “OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS SOBRE RENTA FIJA”

I. INSTRUCCIONES GENERALES:

La información requerida de conformidad con este Anexo deberá ser considerada por los Usuarios para reportar las operaciones con instrumentos derivados cuyo activo subyacente corresponda a renta fija (“derivados sobre renta fija”). Para ello se deberá enviar la información solicitada en este Anexo a la Gerencia de División Estadísticas del BCCh a través del Portal Web del SIID (www.siiid.cl).

Las Empresas bancarias deberán reportar hasta las 10:00 AM horas del día hábil bancario siguiente las Nuevas Operaciones y Modificaciones efectuadas a los Contratos. Adicionalmente, deberán enviar dentro de los primeros cinco días hábiles bancarios de cada mes, los antecedentes de los Contratos Vigentes y Contratos Vencidos del mes inmediatamente anterior, de acuerdo a las instrucciones contenidas en las diferentes secciones de las Especificaciones contenidas en este Anexo.

Los demás Usuarios, que no correspondan a Empresas bancarias, deberán reportar mensualmente, sus derivados con no residentes, dentro de los cinco primeros días hábiles bancarios del mes siguiente, el informe de Contratos Vigentes, considerando las condiciones financieras vigentes al cierre del periodo así como el informe de Contratos Vencidos.

SECCIÓN A: Información Diaria de Nuevas Operaciones, Modificaciones y Términos.

1) Nuevas Operaciones

Para reportar las nuevas operaciones pactadas por los Usuarios, estos deberán enviar al Banco los campos pertenecientes a la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, indicando en el campo “Evento de Reporte” alguno de los eventos detallados en el numeral “2.1 Suscripción”.

2) Modificaciones de los Contratos

Los Usuarios que efectúen modificaciones a sus Contratos, deberán enviar todos los campos previamente reportados actualizados, indicando como “Evento de Reporte” alguno de los señalados en el número “2.2 Modificación”.

Los campos “RUT Usuario (Contraparte 1)”, “LEI Contraparte 1”, “Identificador del Contrato”, “Identificador de Operaciones Estructuradas” y “Fecha y hora de suscripción del Contrato” son los que permitirán identificar la operación previamente informada sobre la cual se aplicará la modificación o el término anticipado. Debido a lo anterior, dichos campos no podrán ser modificados por los Usuarios.

3) Términos Anticipados y Anulaciones de Contratos

En el caso de los Usuarios que trasfieran a un tercero el Contrato previamente reportado o pongan término a este en una fecha anterior a lo inicialmente establecido, deberán reportar al Banco la información que aplica a los eventos de reporte “2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación”, “2.3.2 Cesión” o “2.3.3 Anulación”, según corresponda.



SECCIÓN B: Información Mensual de Contratos Vigentes y Contratos Terminados

1) Contratos Vigentes

Los Usuarios deberán reportar, respecto de cada Contrato Vigente al término del mes calendario, la última información disponible para los campos de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, además de los pertenecientes a las secciones 2 “Pagos”, 3 “Garantías” y 4 “Valor de Mercado”, indicando como “Evento de Reporte” la opción “2.4 Vigencia”.

La información de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación” será entendida como una confirmación sobre las condiciones vigentes del derivado al cierre del mes informado.

La información de la Sección 2 “Pagos” hará referencia a cualquier pago o intercambio de flujos originado por la operación en cuestión, efectuado durante el transcurso del mes informado.

La información de las Secciones 3 “Garantías” y 4 “Valor de Mercado” deberá ser reportada indicando las condiciones vigentes al cierre del mes informado.

2) Contratos Terminados

Los Usuarios deberán reportar, para cada Contrato Terminado indicando como “Evento de Reporte” la opción “2.3.4 Vencimiento”, la información vigente al momento del término de éste, completando la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación” además de la Sección 2 “Pagos”.

Se deberán incluir también mensualmente en este Evento de Reporte aquellos Contratos que fueron terminados por “2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación” o “2.3.2 Cesión”.

La información de la Sección 1 “Condiciones Financieras de la Operación”, será entendida como una confirmación sobre las condiciones vigentes del derivado al momento de su término.

La información reportada en la Sección 2 “Pagos”, hará referencia a cualquier pago o intercambio de flujos originados por el término de la operación en cuestión.

En la información que se proporcione bajo juramento, referida a Contratos sobre renta fija, se precisará si dichos antecedentes dicen relación con el cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI.

II.INFORMACIÓN SOLICITADA

Sección 1: Condiciones Financieras de la Operación

N° Campo	Campo	Descripción original
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 II y IX del CNCI, sobre operaciones con instrumentos derivados.



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>Deberán ser reportados diariamente los registros indicados a continuación.</p> <p>2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Usuario.</p> <p>2.1.2 Adquisición por cesión: Cuando el Usuario 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 Usuario.</p> <p>Deberán ser reportados diariamente los registros indicados a continuación.</p> <p>2.2.1 <i>Recouponing</i>: Modificación de las condiciones financieras de un Contrato a consecuencia de pagos que hacen las partes con el objeto de modificar su valor razonable (<i>mark to market</i>).</p> <p>2.2.2 Modificación de contraparte por cesión: El Usuario 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, que no corresponde a una corrección de reporte, a alguna de las condiciones financieras del Contrato, 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, cambios en las partes compradora o vendedora por causales distintas de cesión (ej. fusión) etc.</p> <p>2.2.4 Corrección de reporte: Rectificación de información enviada previamente por el Usuario 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 Usuario, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.</p> <p>Deberán ser informados diariamente los registros indicados a continuación.</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 Usuario (cedente).</p> <p>2.3.3 Anulación: Eliminación de Contratos informados previamente, debido a que estos Contratos nunca existieron (ej. duplicaciones, cotizaciones, entre otros) o bien no estaban afectos a la regulación de derivados de tasas del III.D.3 del CNF y su respectivo Reglamento Operativo.</p> <p>Deberán ser informados mensualmente los registros indicados a continuación.</p> <p>2.3.4 Vencimiento: Término de las obligaciones que emanan de una operación conforme al plazo establecido en el Contrato previamente informado. Adicionalmente, respecto de los eventos 2.3.1., 2.3.2 y 2.3.3 también deberán proporcionar al cierre del mes respectivo la información de las condiciones financieras vigentes para cuando se puso término a los Contratos.</p> <p>2.4 Vigencia</p> <p>Corresponde a las condiciones financieras vigentes para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vigentes. Este deberá ser enviado mensualmente, junto a la información de valorización del Contrato y sus garantías.</p>
3	RUT Usuario (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de renta fija (Contraparte 1).
4	LEI Contraparte 1	Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de renta fija, si lo tuviere.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

5	RUT Contraparte del Usuario (Contraparte 2)	RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar (Contraparte 2).
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.
7	Nombre o Razón Social Contraparte 2	Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.
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.
9	RUT 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.
10	LEI 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.
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.
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.
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.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

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
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
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 producto de liquidaciones en Cámara de Contraparte Central no se incluyen en este campo.
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 producto de liquidaciones en Cámara de Contraparte Central no se incluyen en este campo.
18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Usuario 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.
19	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.
20	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”.
21	Tasa Pactada	Tasa pactada a futuro del activo de renta fija. Para el caso de una opción este campo corresponde a la <i>Tasa Strike</i> .



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

22	Precio Pactado	Precio pactado a futuro del activo de renta fija. Para el caso de una opción, este campo corresponde al <i>Precio Strike</i> .
23	Posición de la Operación	Indicar si la Contraparte 1 asume la posición compradora o vendedora sobre el instrumentos de renta fija, cuando se utiliza un instrumento distinto de una opción.
24	Instrumento	Tipo de Instrumento al que corresponda la operación informada según la Tabla de Instrumentos Financieros Derivados.
25	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.
26	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 Opciones – Posición en la Operación.
27	Modalidad de Liquidación	Modalidad estipulada en el Contrato para llevar a cabo los pagos o liquidaciones que éste origine, la cual puede ser por compensación o entrega física, según lo señalado en la Tabla Modalidad de Liquidación.
28	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.
29	Moneda Monto Ncional	Código de la moneda en la que está expresado el monto ncional sobre el cual se calculan los flujos a intercambiar, según norma ISO 4217.
30	Monto Ncional	Se debe indicar el monto ncional de la operación.
31	Fecha y Hora de Suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Usuario y 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.
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.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

33	Fecha de <i>Fixing</i>	Fecha en la cual se fijan o determinan los valores de las tasas de rendimiento o precios que se consideran para el cálculo del flujo cuando hay un único intercambio a futuro. En el caso de haber más intercambios se debe indicar la fecha de <i>fixing</i> para cada uno de ellos en la sección de calendario de pagos.
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 de término o liquidación anticipada”.
35	Fecha de Pago de la Operación	Fecha de la última liquidación de la operación.
36	Fecha de Inicio de la Modificación	Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una modificación.
37	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 Usuario (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.
38	Monto Prima/Pago Inicial Recibida(o)	Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.
39	Monto Prima/Pago Inicial Entregada(o)	Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos por cesiones.
40	Objetivo de la Operación	Indicar el objetivo de la operación para la Contraparte 1, según lo indicado en la Tabla de 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
41	Convenio Marco	Indicar tipo y código único asignado al Convenio Marco, si correspondiere, bajo el cual fue negociada la operación, según Tabla de Convenio Marco de contratación de operaciones con productos derivados.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

42	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.
43	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.
44	Cláusula de <i>Recouponing</i>	Indicar si la operación considera o no cláusula de <i>Recouponing</i> en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de <i>Recouponing</i> .
45	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.
46	Fecha de Término o Liquidación Anticipada	Fecha acordada para realizar la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.
47	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.
48	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".
49	RUT Intermediario	RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario Broker que actuó como intermediario en el cierre de la operación.
50	LEI Intermediario	Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>), si lo tuviere, del Broker que actuó como intermediario en el cierre de la operación.



Sección 2: “Pagos”

N° Campo	Campo	Descripción
51	Fecha de Pago	Fecha de pago o liquidación.
52	Monto Pago Recibido	Monto recibido por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. En 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.
53	Monto Pago Entregado	Monto pagado por la Contraparte 1, de acuerdo a lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. En 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.
54	Tipo de Pago Efectuado	Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado

Sección 3: Garantías

N° Campo	Campo	Descripción
55	Moneda de Valorización de Garantía	Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217. En caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.
56	Identificador de la Garantía Recibida	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas que respaldan el Contrato de derivado. En caso de que otras operaciones estén respaldadas por esta misma garantía o portafolio se debe repetir este código 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.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

57	Tipo de Garantía Recibida	<p>Tipo de activo (s) recibido(s) por la Contraparte 1 en garantía para caucionar la obligación de la Contraparte 2 en la operación, según Tabla Tipo de Activos en Garantías. En el caso de corresponder a más de un activo, indicar el porcentaje que representa cada uno de los activos a valor de mercado o valor razonable al último día hábil del mes que se está informando.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
58	Monto Umbral (“Threshold”) para Contraparte 2	<p>Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 2 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de <i>recouping</i>.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
59	Valor Garantía Recibida	<p>Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas 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.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
60	Identificador de la Garantía Entregada	<p>Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías entregadas que respaldan el Contrato de derivado. En caso de que otras operaciones estén respaldadas por esta misma garantía o portafolio se debe repetir este código para cada una de ellas.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
61	Tipo de Garantía Entregada	<p>Tipo de activo (s) entregado(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, según Tabla Tipo de Activos en Garantías. En el caso de ser constituido por más de un activo, indicar el porcentaje de cada uno a valor de mercado o valor razonable al último día hábil del mes que se está informando.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>



62	Monto Umbral (“ <i>Threshold</i> ”) para Contraparte 1	<p>Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 1 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de <i>recouping</i>.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>
63	Valor de Garantía Entregada	<p>Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías constituidas por la Contraparte 1 como caución de las operaciones reportadas, una vez realizado los descuentos pactados aplicables (“<i>haircut</i>”). En el caso que la misma garantía o portafolio de garantías respalden otras operaciones, se debe repetir este valor para cada una de ellas.</p> <p>En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.</p>

Sección 4: “Valor de Mercado”

N° Campo	Campo	Descripción
64	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>) o corresponde a la efectuada por una Entidad de Contraparte Central.
65	Moneda de Valorización	Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.
66	Valor de Mercado	<p>Valor de mercado o valor razonable neto del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando.</p> <p>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.</p>
67	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.



III.D.3.1. –
Compendio de Normas Financieras

68	Opciones: Delta	En este campo se informará, el cambio en unidades monetarias que tendría el valor teórico del contrato cuando el precio o tasa de interés del subyacente, según corresponda, varíe en 1% respecto de su valor vigente
69	Opciones: Gamma	En este campo se informará, el cambio en unidades monetarias que tendría el valor de “delta” cuando el precio o tasa de interés del subyacente, según corresponda, varíe en 1% respecto de su valor vigente.
70	Opciones: Vega	En este campo se informará, el valor de la sensibilidad o cambio de valor teórico de la opción ante una variación de 1% en la volatilidad anualizada del activo subyacente.
71	Ajustes a la Valorización por Riesgo de Contraparte	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de Contraparte de la operación, para la Contraparte 1.
72	Ajustes a la Valorización por BID-OFFER Spread	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por BID-OFFER Spread de la operación, para la Contraparte 1.
73	Otros Ajustes a la Valorización	Indicar monto de otros ajustes al Valor de Mercado Neto de la operación distintos a los informados en los campos anteriores, para la Contraparte 1.



ANEXO N°4

Tablas SIID

Índice

Tabla 1: Naturaleza de la Información.....	51
Tabla 2: Eventos de Reporte.....	51
Tabla 3: Tabla Tipo de Código de Activo Subyacente.....	51
Tabla 4: Tabla de Instrumentos.....	52
Tabla 5: Clase de Opción.....	52
Tabla 6: Posición de la Operación.....	52
Tabla 7: Opciones - Posición en la Operación.....	52
Tabla 8: Instrumento subyacente.....	53
Tabla 9: Modalidad de Liquidación.....	53
Tabla 10: Tipo de Tasa de Interés.....	53
Tabla 11: Objetivo de la Operación.....	55
Tabla 12: Convenio Marco.....	55
Tabla 13: Garantías.....	56
Tabla 14: Cláusula de <i>Recouponing</i>	56
Tabla 15: Cláusula de Término Anticipado.....	56
Tabla 16: Compresión de Cartera.....	56
Tabla 17: Tipo de Activo en Garantía.....	57
Tabla 18: Tipo de Pago Efectuado.....	57
Tabla 19: Método de Valorización.....	57



Tabla 1: Naturaleza de la Información

Código*	Descripción
SI	El Evento de Reporte se comunica en cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI, sobre operaciones con instrumentos derivados.
NO	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.

Tabla 2: Eventos de Reporte

Numeral	Código*	Descripción
1.1.1	NUE	Nuevo contrato
1.1.2	ACS	Adquisición por cesión
1.2.1	MRC	Modificación por <i>recouping</i>
1.2.2	MCS	Modificación de contraparte por cesión
1.2.3	OMD	Otras modificaciones
1.2.4	MCR	Modificación por corrección de reporte
1.3.1	AOC	Término por caducidad, anticipo o resciliación
1.3.2	CES	Término por cesión
1.3.3	ANU	Término por anulación
1.3.4	MVE	Mensual operaciones vencidas
1.4.1	MVI	Mensual operaciones vigentes

Tabla 3: Tabla Tipo de Código de Activo Subyacente

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



Tabla 4: Tabla de Instrumentos

Código*	Descripción	Subyacente que aplica
CCS	<i>Cross Currency Swap</i>	Monedas
FOB	<i>Forward Observado</i>	Monedas
FXS	<i>FX Swap</i>	Monedas
FUT	Futuro	Monedas, tasas de interés y renta fija
FWD	<i>Forward</i>	Monedas, tasas de interés y renta fija
STN	<i>Swaption</i>	Monedas y tasas de interés
CAL	Opción <i>Call</i>	Monedas
PUT	Opción <i>Put</i>	Monedas
CAP	Opción <i>Cap</i>	Tasas de interés y renta fija
FLR	Opción <i>Floor</i>	Tasas de interés y renta fija
SWP	<i>Interest Rate Swap</i>	Tasas de interés
OTR	Otros	Monedas, tasas de interés y renta fija

Tabla 5: Clase de Opción

Código*	Descripción
AM	Americana
BE	Bermuda
EU	Europea
AS	Asiática
OT	Otras
NA	No Aplica

Tabla 6: Posición de la Operación

Código*	Descripción
BYER	Compradora
SLLR	Vendedora

Tabla 7: Opciones - Posición en la Operación

Código*	Descripción
BYER	Compradora
SLLR	Vendedora



Tabla 8: Instrumento subyacente

Código*	Descripción	Subyacente que aplica
CCS	<i>Cross Currency Swap</i>	Monedas
COS	<i>Currency Swap</i>	Monedas
SWP	<i>Interest Rate Swap</i>	Tasas de interés

Tabla 9: Modalidad de Liquidación

Código*	Descripción
CO	Compensación
EF	Entrega Física

Tabla 10: Tipo de Tasa de Interés

Código	Descripción
FIXEDRT	Tasa fija
TABUF3M	TAB UF a 90 días
TABUF6M	TAB UF a 180 días
TABU12M	TAB UF a 360 días
TABN01M	TAB nominal a 30 días
TABN03M	TAB nominal a 90 días
TABN06M	TAB nominal a 180 días
TABN12M	TAB nominal a 360 días
TADO01M	TADO a 30 días
TADO02M	TADO a 60 días
TADO03M	TADO a 90 días
TADO06M	TADO a 180 días
TADO12M	TADO a 360 días
TNAICP0	Tasa nominal anualizada ICP
TRAICP0	Tasa real anualizada ICP
PRIMERT	<i>Prime Rate</i>
US000ON	LIBOR en Dólares de los EE.UU <i>overnight</i> (ICE)
US0001M	LIBOR en Dólares de los EE.UU a 30 días (ICE)
US0001W	LIBOR en Dólares de los EE.UU a 7 días (ICE)
US0002M	LIBOR en Dólares de los EE.UU a 60 días (ICE)
US0003M	LIBOR en Dólares de los EE.UU a 90 días (ICE)
US0006M	LIBOR en Dólares de los EE.UU a 180 días (ICE)
US0012M	LIBOR en Dólares de los EE.UU a 360 días (ICE)



Código	Descripción
SOFRATE	SOFR (<i>Secured Overnight Financing Rate</i>) de la Reserva Federal de Nueva York.
FEDFUND	Tasa de Fondos Federales de los EE.UU (<i>US Federal Funds Effective Rate</i>)
USOBFRT	<i>United States Overnight Bank Funding Rate</i>
USOISON	OIS (<i>Overnight Index Swap</i>) en Dólares de los EE.UU.
USTN10Y	Tasa de la curva de rendimiento del Tesoro de los EE.UU a 10 años
USTN03Y	Tasa de la curva de rendimiento del Tesoro de los EE.UU a 3 años
EE000ON	LIBOR en Euros <i>overnight</i> (ICE)
EE0001W	LIBOR en Euros a 7 días (ICE)
EE0001M	LIBOR en Euros a 30 días (ICE)
EE0002M	LIBOR en Euros a 60 días (ICE)
EE0003M	LIBOR en Euros a 90 días (ICE)
EE0006M	LIBOR en Euros a 180 días (ICE)
EE0012M	LIBOR en Euros a 360 días (ICE)
ESTERON	ESTER (Euro Short-Term Rate)
EUR001W	Euribor a 1 semana
EUR002W	Euribor a 2 semanas
EUR001M	Euribor a 30 días
EUR002M	Euribor a 60 días
EUR003M	Euribor a 90 días
EUR006M	Euribor a 180 días
EUR009M	Euribor a 270 días
EUR012M	Euribor a 12 meses
EONIAON	EONIA (<i>Euro Overnight Index Average</i>)
BP000ON	LIBOR en Libras esterlinas <i>overnight</i> (ICE)
BP0001W	LIBOR en Libras esterlinas a 7 días (ICE)
BP0001M	LIBOR en Libras esterlinas a 30 días (ICE)
BP0002M	LIBOR en Libras esterlinas a 60 días (ICE)
BP0003M	LIBOR en Libras esterlinas a 90 días (ICE)
BP0006M	LIBOR en Libras esterlinas a 180 días (ICE)
BP0012M	LIBOR en Libras esterlinas a 360 días (ICE)
SONIAON	SONIA (Sterling Overnight Interbank Average Rate)
SF000ON	LIBOR en Francos suizos <i>spot next day</i> (ICE)
SF0001W	LIBOR en Francos suizos a 7 días (ICE)
SF0001M	LIBOR en Francos suizos a 30 días (ICE)
SF0002M	LIBOR en Francos suizos a 60 días (ICE)
SF0003M	LIBOR en Francos suizos a 90 días (ICE)
SF0006M	LIBOR en Francos suizos a 180 días (ICE)



Código	Descripción
SF0012M	LIBOR en Francos suizos a 360 días (ICE)
JY000ON	Libor en Yenes japoneses <i>spot next day</i> (ICE)
JY0001W	Libor en Yenes japoneses a 7 días (ICE)
JY0001M	Libor en Yenes japoneses a 30 días (ICE)
JY0002M	Libor en Yenes japoneses a 60 días (ICE)
JY0003M	Libor en Yenes japoneses a 90 días (ICE)
JY0006M	Libor en Yenes japoneses a 180 días (ICE)
JY0012M	Libor en Yenes japoneses a 360 días (ICE)
OTHERRT	Otros

Tabla 11: Objetivo de la Operación

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

* NOTA: La clasificación de objetivos de la operación de derivado descrita en la tabla anterior, corresponde con la Norma Internacional de Información Financiera (IFRS). Las categorías NEG y CPB corresponderán a instrumentos financieros derivados clasificados contablemente para negociación. La categoría CPB 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 que no cuenten con lo anteriormente señalado, deberán informar la totalidad de los instrumentos de negociación con el código NEG.

Tabla 12: Convenio Marco

Código*	Descripción
CCGG[númeroid]	Condiciones Generales del Banco Central de Chile.
ISDA[númeroid]	<i>International Swaps and Derivatives Association.</i>
OTRO[númeroid]	Otros convenios no contemplados previamente.
NOSU[númeroid]	No está sujeto a convenio marco.

* NOTA: los primeros cuatro caracteres del código de la Tabla 11, corresponden al tipo de Convenio Marco bajo la cual fue negociado el contrato de derivado; los siguientes caracteres hacen referencia al código de identificación interno asignado al Convenio Marco de contratación por la Contraparte 1.



Tabla 13: Garantías

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

Tabla 14: Cláusula de *Recouping*

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

Tabla 15: Cláusula de Término Anticipado

Código*	Descripción
CO1	A favor de la Contraparte 1
CO2	A favor de la Contraparte 2
AMP	Opcional ambas partes
NOT	No tiene

Tabla 16: Compresión de Cartera

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



Tabla 17: Tipo de Activo en Garantía

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

Tabla 18: Tipo de Pago Efectuado

Código*	Descripción
I	Intereses
C	Capital
P	Prima o Pago Inicial
A	Anticipo
I	Garantías: Margen Inicial
V	Garantías: Margen de Variación
G	Cesión
R	Recouponing
O	Otros

Tabla 19: Método de Valorización

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



ANEXO N° 5

SOLICITUD DE ACCESO PARA REMITIR LA INFORMACIÓN REQUERIDA AL SISTEMA INTEGRADO DE INFORMACIÓN SOBRE TRANSACCIONES DE DERIVADOS (SIID) DEL BANCO CENTRAL DE CHILE

_____ de _____ de 20 _____.

Sres.

[_____]

Banco Central de Chile

Presente

Por medio del presente instrumento, [_____], en adelante “el Participante”, solicita al Banco Central de Chile (BCCh) su autorización para remitir la información requerida al Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (SIID) administrado por el BCCh. Lo anterior, de acuerdo con la normativa que actualmente se encuentra contenida en el Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras (CNF) y su correspondiente Reglamento Operativo, y las modificaciones que en el futuro pueda introducir el BCCh en el ejercicio de sus atribuciones legales.

Para fines de remitir la información que el BCCh requiera a través del SIID, el Participante se obliga a observar los términos y condiciones establecidos en el Capítulo III.D.3 y su Reglamento Operativo, así como la normativa que la modifique o reemplace y las instrucciones que la Superintendencia de Bancos e Instituciones Financieras - o el organismo que la reemplace o suceda - pueda impartir en ejercicio de sus facultades, en su caso, que resulten aplicables al Participante.

Lo anterior, comprende la aceptación expresa del Participante de la facultad del BCCh de resolver, a su juicio exclusivo, cualquier duda que se presente respecto de la aplicación o interpretación de su normativa, atribución cuyo ejercicio no podrá, en ningún caso, entenderse como antecedente o causa constitutiva de daño, perjuicio, detrimento o menoscabo para el mismo. Asimismo, el Participante acepta expresamente y a plenitud cualquier modificación, adición, aclaración y/o sustitución posterior que se realice tanto al citado Capítulo como al Reglamento Operativo, las que serán comunicadas por los medios que el BCCh estime satisfactorios a su juicio exclusivo.

Del mismo modo, el Participante acepta cumplir los requerimientos relacionados a las características y especificaciones técnicas que el BCCh pueda determinar en materia de comunicaciones, registros, reportes y otros aspectos relacionados al SIID, declarando asimismo conocer y aceptar que el BCCh -en su calidad de propietario y administrador de este Sistema- puede modificar dichos requerimientos con la periodicidad y oportunidad que estime conveniente, todo lo cual el Participante se obliga a cumplir. Lo anterior, comprende también la aceptación y debido cumplimiento de los términos y condiciones que el BCCh pueda establecer para el uso del SIID en el portal web de su acceso.

Al final de esta comunicación el Participante individualiza ante el BCCh, la o las personas que actuarán como sus apoderados autorizados para representarlo en el envío de la información antedicha al BCCh a través del SIID, en adelante los “Administradores de Perfiles”, encontrándose estos además facultados para delegar dicha función en otras personas. El Participante adjunta, como parte de esta comunicación, una declaración jurada ante Notario que acredita que el o los respectivos apoderados designados al efecto, cuentan con poder suficiente para actuar en su nombre y representación en el envío de los reportes que se efectúen al SIID. Asimismo, se deja constancia que toda revocación o modificación de los referidos “Administradores de Perfiles” previamente designados, será informada mediante carta suscrita por el Participante o su representante legal, junto con acompañar la declaración jurada antedicha respecto de los nuevos Administradores que designe.



En este contexto, el Participante declara conocer y aceptar que toda utilización, acceso y operación del SIID realizada por los “Administradores de Perfiles” acreditados ante el Banco Central, o por los usuarios que dicho Administrador pueda designar, se entenderá para todos los efectos legales como ejecutada por el Participante. Por lo anterior, el Participante se obliga a adoptar todas las medidas jurídicas, administrativas y de control y gestión de riesgos, que sean necesarias para que el SIID sea utilizado sólo por las personas que ha facultado para ello.

Al respecto, y tratándose del o los “Administradores de Perfiles”, el BCCh hará entrega de claves de acceso al SIID, las que en el caso de otros usuarios designados por estos últimos serán otorgadas directamente por el respectivo “Administrador de Perfiles”. Las claves de acceso referidas, serán secretas, personales e intransferibles, circunstancia respecto de la cual el Participante procurará su debido resguardo. Por ende, el Participante, acepta que será el único y exclusivo responsable por el adecuado uso de las claves asignadas o configuradas y por la información que se ingrese al SIID en su representación.

En consecuencia, el Participante libera de responsabilidad y se obliga a indemnizar al BCCh respecto de cualquier pérdida o perjuicio que pueda sufrir con motivo del uso que haga del SIID, incluyendo reclamaciones interpuestas en contra del BCCh por otros participantes o por terceros.

En caso que la información reportada al SIID sea enviada a través de un Agente Autorizado, conforme lo permite la citada normativa del BCCh, el Participante se obliga a que dicho Agente actúe en su representación y cumpla con lo señalado en la presente Solicitud, así como lo dispuesto en el referido Capítulo III.D.3 del CNF y su correspondiente Reglamento Operativo, incluyendo las modificaciones que en el futuro el BCCh pueda introducir a la misma en el ejercicio de sus atribuciones legales. Según lo indicado, para el caso que el Participante remita información a través de uno o más Agentes Autorizados, deja constancia de su individualización en la presente solicitud.

Conforme a lo expresado, el Participante declara tener conocimiento que la información que proporcione sobre contratos de derivados al Banco Central de Chile (BCCh), en forma electrónica a través del SIID, será entregada bajo juramento, en cuanto a que los datos contenidos en los reportes que remita al BCCh, corresponderán en forma fidedigna y exacta a las operaciones que el Participante informe en cada caso, debiendo precisar además si los antecedentes que conforman el respectivo reporte dicen o no relación con el cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del Compendio de Normas de Cambios Internacionales (CNCI).

Al respecto, tratándose de información cambiaria, el Participante deja constancia expresa que estos antecedentes los proporcionará al Banco Central de Chile para dar cumplimiento a las normas contempladas en los Capítulos citados del CNCI, establecidas por el BCCh conforme a lo dispuesto en el Párrafo Octavo del Título III de su Ley Orgánica Constitucional, las que el Participante declara conocer asumiendo la responsabilidad que se establece en la normativa legal antedicha.

DATOS A COMPLETAR

A. Identificación del Participante (Completar según corresponda N° 1 o 2 siguiente)

1. En caso que el Participante sea persona jurídica:

Razón Social:
RUT:
Domicilio:
Comuna:
Ciudad:
Teléfono (país-ciudad-número):
Nombre del Gerente General:
Correo electrónico del Gerente General:
Nombre del Representante Legal:
Correo electrónico del Representante Legal:



2. En caso que el Participante sea persona natural:

Nombre (nombre, apellido paterno, apellido materno):
N° Cédula de identidad:
Nacionalidad:
Domicilio:
Comuna:
Ciudad:
Teléfono (país-ciudad-número):
Correo electrónico:

B. Identificación de él o los “Administradores de Perfiles”:

1. Nombre (nombre, apellido paterno, apellido materno):
N° Cédula de identidad:
Correo electrónico:
Teléfono (país – ciudad - número):
Cargo de la persona autorizada:
Unidad o Departamento donde trabaja la persona autorizada:

2. Nombre (nombre, apellido paterno, apellido materno):
N° Cédula de identidad:
Correo electrónico:
Teléfono (país – ciudad - número):
Cargo de la persona autorizada:
Unidad o Departamento donde trabaja la persona autorizada:

3. Nombre (nombre, apellido paterno, apellido materno):
N° Cédula de identidad:
Correo electrónico:
Teléfono (país – ciudad - número):
Cargo de la persona autorizada:
Unidad o Departamento donde trabaja la persona autorizada:

C. Identificación de Agente (s) Autorizados para efectuar reportes al SIID:

1. Nombre o Razón Social:
RUT:
Domicilio:
Comuna:
Ciudad:
País:
Teléfono (país-ciudad-número):
Nombre del Gerente General:
Correo electrónico del Gerente General:
Nombre del Representante Legal:
Correo electrónico del Representante Legal:

Nombre(s) y firma(s) Autorizada(s) del Participante



DECLARACIÓN JURADA

El /Los suscrito(s) _____ declara(n) bajo juramento tener la calidad de representante(s) legal(es) de _____ RUT_____. En tal calidad declara(n) además, lo siguiente:

- 1.- Que posee(n) los poderes suficientes para designar a los “Administradores de Perfiles” señalados en esta Solicitud de Acceso, en su calidad de apoderados especialmente autorizados para remitir la información requerida al Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (SIID) del Banco Central de Chile.
- 2.- Que la o las personas designadas como “Administradores de Perfiles” tienen poderes suficientes para asumir tal representación ante el Banco Central de Chile y que pueden, asimismo, delegarla cuantas veces estimen conveniente en otras personas.

En _____ a ____ de _____ de _____

Firmó ante mí __ (Nombre de el o los representantes legales de la empresa) _____

Instrucciones para completar la presente Solicitud de Acceso:

1. Si esta Solicitud es presentada por un Participante que corresponda a una persona jurídica, se deberá completar la declaración jurada ante Notario que se incluye al final de ésta.
En cambio, si esta Solicitud es presentada directamente por un Participante que corresponda a una persona natural, la firma de esta solicitud deberá ser autorizada ante Notario o ante el Ministro de Fe que corresponda, debidamente legalizada o apostillada, según corresponda y deberá acompañar fotocopia de ambos lados de la cédula de identidad del Participante, también autorizada ante Notario.
2. En la Sección A de “Datos a Completar” de esta Solicitud, en la cual se contiene la identificación del Participante, sólo se debe completar su numeral 1, en caso de tratarse de una persona jurídica, o su numeral 2, en caso de corresponder a una persona natural, pero no ambas conjuntamente.
3. En caso de requerir identificar más “Administradores de Perfiles” que los incluidos en esta Solicitud, se deberá ajustar el presente formato en esa Sección.
4. En caso de existir enmendaduras, la solicitud será rechazada.
5. Esta solicitud debe presentarse en la Gerencia de División Estadísticas del BCCh, ubicada en Morandé 115, de lunes a viernes, entre las 09:00 y las 16:00 horas, en días hábiles bancarios.