

ESPECIFICACIONES DEL FORMULARIO

“OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS SOBRE TASAS DE INTERÉS”

I. INSTRUCCIONES GENERALES:

Este Formulario deberá ser utilizado por los Usuarios para informar las operaciones con Instrumentos Derivados sobre tasas de interés extranjeras o bien sobre tasas de interés locales en los que la compensación sería en moneda extranjera. Para ello se deberá enviar debidamente lleno al Banco, durante los primeros diez días corridos de cada mes, para los contratos suscritos, modificados, cedidos y compensados el mes inmediatamente anterior.

El USUARIO deberá identificar con una "X" en el recuadro pertinente, si el Formulario corresponde a un Informe de: "Suscripciones", "Modificaciones", "Cesiones" (en este caso sólo se indicará cuando el Usuario sea una entidad del Mercado Cambiario Formal), o "Compensaciones".

Suscripciones:

- 1) Si se trata de un "Informe de Suscripciones", cada operación deberá ser identificada en una sola línea, con todos sus campos completos. Todas las operaciones deben ordenarse correlativamente por su N° de contrato, sin dejar líneas en blanco. No obstante, en el caso de las operaciones Swap o similares que constan de varios flujos que devengan pagos por compensaciones entre las partes, éstos, a partir del segundo período deberán detallarse en su totalidad sólo entre los campos 25 al 33, sin necesidad de repetir la información contenida en los campos 11 al 24.

- 2) Modificaciones:

Si se trata de un "Informe de Modificaciones" se deberá indicar necesariamente para cada operación los campos "Nombre o Razón Social de la Contraparte", "N° de Contrato", y "Fecha de Suscripción". En el resto de la (las) columna (s), correspondientes al contrato que se está modificando, sólo se llenan el o los otros datos sujetos a modificación.

- 3) Cesiones:

En el caso de un "Informe de Cesiones" se deberá tener presente lo señalado en el número 2 de las Disposiciones Generales de este Capítulo. Para este efecto, se debe indicar, para cada operación los campos "N° de Contrato" y "Fecha de Suscripción". En el resto de las columnas, sólo se llenan los datos correspondientes al "Código / RUT" y "Nombre o Razón Social de la contraparte".

II. INFORMACION SOLICITADA:

- 1 al 9: Informar con los datos específicos del Usuario, Persona Encargada y Fecha de Envío del Formulario. El Código Sector Económico debe corresponder al referido en la Tabla respectiva en el Capítulo I de este Manual.
10. Período Informado : Especificar el mes de suscripción/compensación de las operaciones presentadas en este Formulario, en formato mm/aaaa. Este dato se omite en el caso del Informe de Modificaciones y de Cesiones.
11. Código / Rut: En caso que se trate de operaciones realizadas con personas domiciliadas o residentes en el exterior, indicar el código asignado a la contraparte extranjera de acuerdo a lo establecido en la dirección Internet http://www.bcentral.cl/_files/contrapartes/codconex.pdf. Para las operaciones realizadas en Chile con residentes se deberá indicar el Rol Unico Tributario de cada contraparte informada.
12. Nombre o Razón Social: Indicar el nombre o razón social de la contraparte informada. Anotar de corrido sin abreviaciones hasta el alcance que permita el campo.
13. Código País: Indicar el “Código País” de dicha contraparte, deberá corresponder a los referidos en la Tabla respectiva del Capítulo I, de este Manual.
14. País: Deberá indicar el nombre del país de la Contraparte.
15. Código Instrumento: Se debe indicar el código del Instrumento utilizado, de acuerdo a lo siguiente:
01: Forward
02: Futuro
03: Opción Call
04: Opcion Put
05: Swap
06: Cap
07: Floor
08: Collar
99: Otro.
16. Nombre Instrumento: Especificar el nombre del instrumento utilizado

17. N° de Contrato: Asignar un número correlativo al contrato, el cual debe ser numérico y único para la fecha indicada en N° 10, además debe tener un largo *máximo de 12 caracteres*. Ello implica que no podrá duplicarse el número de contrato para una misma fecha de suscripción. No obstante lo anterior, existe una excepción en caso del instrumento swap, dado que en este tipo de contrato se suscribe la operación en una fecha para distintas fechas de maduración, las cuales deben ser informadas en distintas líneas del Formulario, con un mismo número de contrato y una misma fecha de suscripción.
18. Tasa de Interés Pagada por el Usuario: Señalar la letra correspondiente al tipo de tasa de interés que el Usuario se compromete a pagar:
“F” si los intereses a pagar por el Usuario sobre el monto nocional se calculan sobre la base de una tasa Fija;
“V” si dichos intereses se calculan sobre la base de una tasa Variable.
19. Tasa de Interés Pagada por la Contraparte: Señalar la letra correspondiente al tipo de tasa de interés que la contraparte se compromete a pagar:
“F” si los intereses a pagar por la contraparte sobre el monto nocional se calculan sobre la base de una tasa Fija;
“V” si dichos intereses se calculan sobre la base de una tasa Variable.
20. Fecha de Suscripción: Señalar la fecha en que se cierra el contrato (conocida internacionalmente como Trade Date), en formato dd/mm/aaaa.
21. Fecha Efectiva: Señalar la fecha cuando comienza la cobertura o protección del contrato (conocida internacionalmente como Effective Date o Start Date), en formato dd/mm/aaaa.
22. Fecha de Término: Señalar la fecha cuando termina el contrato (conocida internacionalmente como Termination Date; Maturity Date), en formato dd/mm/aaaa.
23. Código Moneda Monto Nocional: Indicar el código establecido en la respectiva Tabla del Capítulo I de este Manual, para la moneda en que está expresado el monto nocional.
24. Nombre Moneda Monto Nocional: Indicar la moneda en que está expresado el monto nocional, pudiendo usarse el nombre completo, o bien, las abreviaturas convencionales de las operaciones de comercio exterior y cambios internacionales, tales como: US\$, ¥, €.
25. Período N°: Indicar correlativamente el número de cada período de compensación.

26. Rango del Período: Señalar entre qué fechas (incluidas) se comprende cada período de compensación, en formato dd/mm/aaaa.
27. N° Días: Se debe expresar el número de días comprendidos entre las fechas para las cuales se definió el Rango del Período.
28. Monto Nocional: Indicar el monto nocional del contrato correspondiente a cada período de compensación.
29. Tasa Fija: Utilizar formato 99,99 %.
30. Base Días Tasa Fija: Indicar la base de días de cálculo para el cómputo del pago de intereses sobre el monto nocional. Por ejemplo: Actual / 360, 180 / 360, 90 / 360, etc.
31. Nombre Tasa Variable: Señalar la cualificación de la tasa variable a pagar, utilizando para ello los códigos señalados en la referida Tabla del Capítulo I de este Manual.
32. Spread: Especificar el margen o cantidad nominal que se adiciona o resta a la tasa variable base, anteponiendo el signo "-", en este último caso.
33. Base Días Tasa Variable: Ver N° 29.
34. Prima Total
(sólo para Opciones): Este campo se debe completar sólo en caso que el instrumento sea una opción, señalando el valor total pagado (con signo negativo) o recibido (con signo positivo), al comprar o emitir una opción, respectivamente. Se deberá indicar la prima total pagada o recibida por cada opción. En el caso de moneda distinta de dólar, se deberá expresar este valor aplicando la paridad correspondiente a la fecha del pago, la cual se encuentra disponible en la página web del Banco, cuya dirección es <http://www.bcentral.cl>.