

B.12 IDENTIFICACION ACTIVOS SUJETOS A VAR

El archivo VAaamddG.TXT deberá contener la siguiente estructura:

- Identificación (registro tipo 1) : Contendrá información que permita identificar a la compañía que informa y periodo de la información. Cabe señalar que sólo se informará un registro de este tipo y deberá ser el primero del archivo.
- Detalle (registro tipo 2) : Contendrá información de:
- Los activos considerados en el cálculo de VaR de la compañía para el periodo.
 - La identificación de los activos asociados a seguros de vida con cuentas de inversión.
- Totales (registro tipo 3) : Contendrá información de cuadratura de los registros de detalle informados. Cabe señalar que sólo se informará un registro de este tipo y deberá ser el último del archivo.

Registro Tipo 1 de IDENTIFICACION

<u>CAMPO</u>	<u>DESCRIPCION</u>	<u>PICTURE</u>
TIPO	Tipo Registro. En este caso corresponde a "1" (identificación).	9(01)
RUT	RUT de la compañía informante. Es obligatorio y no puede informarse en ceros.	9(09)
VERIFICADOR	Dígito verificador del RUT de la compañía informante.	X(01)
NOMBRE	Nombre o razón social de la compañía informante.	X(60)
PERIODO	Período que corresponde la información. El formato de esta fecha será la de AAAAMM.	9(06)
FILLER	Se deberá informar espacios.	X(59)

Registro tipo 2 de DETALLE

1. Información general de identificación de activos sujetos a VaR

<u>CAMPO</u>	<u>DESCRIPCION</u>	<u>PICTURE</u>
TIPO	Tipo Registro. En este caso corresponde a "2".	9(01)
CODIGO_OPERACION	Código que identifica la operación. Se informará de acuerdo a la siguiente codificación: CDT: Compra definitiva o a término. CRV: Compra con compromiso de venta. PRV: Posiciones de Renta Variable.	X(03)
FOLIO_OPERACION	Solo para referencia de activos de Renta Fija. Corresponde al folio informado en la posición para identificar el activo.	9(10)
ITEM_OPERACION	Solo para referencia de activos de Renta Fija Secuencia del instrumento dentro del folio de la operación.	9(03)
NOMBRE_DEL_FONDO	Para activos que estén asociados a fondos que respalden seguros de vida con cuenta de inversión, se debe informar el	X(30)

	<p>nombre del Fondo al cual pertenece. Se entenderá por fondo al tipo de plan o modalidades de inversión convenidos para los seguros con cuentas de inversión.</p> <p>Para activos sujetos a requisito patrimonial (que no respalden seguros de vida con cuenta de inversión), debe informarse con el nombre fijo "CARTERA PROPIA".</p>	
NEMOTECNICO	<p>Corresponde obligatoriamente informar el código nemotécnico de acuerdo a las instrucciones impartidas por Circular N° 1085, o la que la reemplace. En el caso de los instrumentos no seriados (mutuos hipotecarios, contratos de leasing de bienes raíces y créditos sindicados), se utilizará el código asignado por esta Superintendencia según lo señalado en Anexo N° 1 de esta Circular. En el caso de instrumentos financieros de renta fija emitidos por empresas nacionales y transados en el extranjero, corresponde informar el código universal "ISIN" (International Securities Identification Number), a falta de éste, el código "CUSIP" (Committee On Uniform Securities Identification Procedures).</p> <p>De no existir los anteriores, se deberá consultar a esta Superintendencia.</p>	X(30)

2. Información para valorización de instrumentos.

<u>CAMPO</u>	<u>DESCRIPCION</u>	<u>PICTURE</u>
TASA_MERCADO	Solo Renta Fija: Corresponde a la tasa de mercado que fue utilizada para el cálculo del valor de mercado.	9(03)V9(04)
BETA_UTILIZADO	Solo para el caso de acciones nacionales: corresponde al valor del Beta utilizado para el cálculo del VaR.	-9(03)V9(04)
PRECIO_MERCADO_UNITARIO	Solo Títulos de Renta Variable: Corresponde al valor de la cuota o acción que fue utilizado para el cálculo del valor de mercado.	9(11)V9(06)
CODIGO_VERTICE	Corresponde al código del vértice de riesgo en que fue asignado el activo en el cálculo de VaR. Se informará de acuerdo a la codificación definida en SEIL, codificación SVS, vértices de riesgo.	X(10)

3. Valor utilizado en cálculo de VaR

<u>CAMPO</u>	<u>DESCRIPCION</u>	<u>PICTURE</u>
VALOR_MERCADO	Corresponde al valor de mercado del activo a la fecha de cierre del mes a que se refiere la información, expresado en UF. Estos valores deben estar expresados según el valor de la UF a este día.	-9(12)V9(04)

Registro tipo 3 de TOTALES

<u>CAMPO</u>	<u>DESCRIPCION</u>	<u>PICTURE</u>
TIPO	Tipo Registro. En este caso corresponde a "3".	9(01)
TOTAL	Corresponde al número total de registros informados incluidos el de IDENTIFICACION y el de TOTALES.	9(06)
FILLER	Se deberá informar espacios.	X(129)