

## 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	<b>Solo Renta Fija:</b> Corresponde a la tasa de mercado que fue utilizada para el cálculo del valor de mercado.	9(03)V9(04)
BETA_UTILIZADO	<b>Solo para el caso de acciones nacionales:</b> corresponde al valor del Beta utilizado para el cálculo del VaR.	-9(03)V9(04)
PRECIO_MERCADO_UNITARIO	<b>Solo Títulos de Renta Variable:</b> 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)