

## B.14 MATRIZ DE CORRELACION

El archivo C22aammddG.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 la matriz de correlación de la compañía en el periodo.
- 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)

### Registro tipo 2 de DETALLE

<u>CAMPO</u>	<u>DESCRIPCION</u>	<u>PICTURE</u>
TIPO	Tipo Registro. En este caso corresponde a "2" (detalle).	9(01)
CODIGO_VERTICE_X	Corresponde al código del vértice de riesgo al cual fue asignado el activo, en el cálculo de VaR. Se informará de acuerdo a la codificación definida en definida en SEIL, codificación SVS, vértices de riesgo.	X(10)
CODIGO_VERTICE_Y	Corresponde al código del vértice de riesgo al cual 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)
VALOR_CORRELACION	Corresponde al valor de las correlaciones entre los distintos vértices de riesgo. Su rango de valores se mueve entre [-1, 1].	-9(01)V9(03)
FILLER	Se deberá informar espacios.	X(51)

### 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 numero total de registros informados incluidos el de IDENTIFICACION y el de TOTALES.	9(06)

FILLER	Se deberá informar espacios.	X(70)
--------	------------------------------	-------