

B.7 INVERSIONES EN INSTRUMENTOS DERIVADOS Y PACTOS

- Formato de Registro : El Archivo PddaamddG.TXT deberá contener la siguiente estructura:
- Identificación (Registro Tipo 1): contendrá información que permita identificar a la Compañía que informa y período 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 Contratos de Opciones.
- Detalle (Registro Tipo 3) : contendrá información de los Contratos de Forwards
- Detalle (Registro Tipo 4) : contendrá información de los Contratos de Futuros.
- Detalle (Registro Tipo 5) : contendrá información de los Contratos de Swaps.
- Detalle (Registro Tipo 6) : contendrá información de los Contratos de Pactos.
- Detalle (Registro Tipo 7) : contendrá cuadratura de los registros de detalle informados. Cabe señalar que sólo se informará un solo 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 de registro. En este caso corresponde tipo "1".	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 a que corresponde la información. El formato de esta fecha será la de AAAAMM, éste deberá coincidir con lo informado en el nombre del archivo que contiene la información.	9(06)
FILLER	Se deberá informar espacios.	X(406)

Registro tipo 2 DETALLE

INFORMACIÓN GENERAL DE IDENTIFICACIÓN DE LOS CONTRATOS DE OPCIONES.

<u>CAMPO</u>	<u>DESCRIPCION</u>	<u>PICTURE</u>
TIPO	Tipo de registro. En este caso corresponde tipo "2".	9(01)
OBJETIVO_CONTRATO	Corresponde informar el objetivo del contrato derivado, de acuerdo a lo señalado en la NCG N°200 de fecha 07.08.2006. Se señalará de acuerdo a la siguiente codificación: INV : Inversión CBE : Cobertura de riesgos financieros	X(03)
TIPO_OPERACION	Código que identifica las operaciones informadas por la compañía, deben informarse todas las operaciones vigentes a la fecha de presentación de la información. Se informará de acuerdo a la codificación definida en la página web de esta Superintendencia en el módulo SEIL, Codificación S.V.S., Instrumentos.	X(10)
FOLIO_OPERACION	Corresponde al número de la papeleta de la mesa de dinero de la compañía, donde se registra la compra del instrumento derivado.	9(10)

	En caso de no poder obtener este número se deberá asociar al documento contable que respalda la compra del instrumento.	
ITEM_OPERACION	Secuencia del instrumento derivado dentro del folio de la operación. No pueden existir dos instrumentos derivados con igual folio e ítem operación.	9(03)
FECHA_DE_LA_OPERACION	Corresponde informar la fecha de inicio del contrato con el siguiente formato: AAAAMMDD.	9(08)
FECHA_DE_VENCIMIENTO_DEL_CONTRATO	Corresponde informar la fecha de término del contrato con el siguiente formato: AAAAMMDD.	9(08)
NOMBRE	Corresponde informar el nombre o razón social de la contraparte de la operación. Para el caso de las operaciones realizadas con bancos nacionales se informará de acuerdo a codificación definida en Seil, Codificación SVS, Códigos Circular 1835, Códigos de Bancos, Nombre del Banco para C.1835	X(60)
NACIONALIDAD	Corresponde informar la nacionalidad de la contraparte de la operación, de acuerdo a la codificación definida en SEIL, Codificación SVS, Países.	X(02)
RELACIONADO	Corresponde informar si la contraparte de la operación está relacionada con la compañía de seguros. Se señalará de acuerdo a la siguiente codificación: RE : Relacionado NR : No Relacionado	X(02)
CLASIFICACION_DE_RIESGO	Corresponde informar la menor clasificación de riesgo vigente de la contraparte de la operación. Si la contraparte no contara con clasificación de riesgo se debe informar S/C.	X(15)
ACTIVO_OBJETO_POSICION_LARGA (nombre)	Corresponde informar el activo objeto para opciones con posición larga, para opciones con posición corta indicar NO APLICA. Se debe informar el código nemotécnico del instrumento, ya sea de acuerdo a lo instruido en la Circular 1085, o la que la reemplace, de esta Superintendencia, o el código asignado según lo señalado en Anexo N° 1 de la presente Circular, aquel asignado por las entidades bursátiles o el código universal "ISIN" (International Securities Identification Number), a falta de éste, el código "CUSIP" (Committee On Uniform Securities Identification Procedures). Para el caso de una moneda como activo subyacente se debe informar el código definido en SEIL, codificación S.V.S., Unidades Monetarias. Si el activo subyacente es una tasa, si ésta es variable se informará la tasa de interés de referencia del instrumento, por ejemplo Libor 360. Si es un interés fijo se llenará con la tasa fijada. De no existir los anteriores, se deberá consultar a esta Superintendencia.	X(30)
ACTIVO_OBJETO_POSICION_CORTA (nombre)	Corresponde informar el activo objeto para opciones con posición corta, para opciones con posición larga indicar NO APLICA. Se debe informar el código nemotécnico del instrumento, ya sea de acuerdo a lo instruido en la Circular 1085, o la que la reemplace, de esta Superintendencia, o el código asignado según lo señalado en Anexo N° 1 de la presente Circular, aquel asignado por las entidades bursátiles o el código universal "ISIN" (International Securities Identification Number), a falta de éste, el código "CUSIP" (Committee On Uniform Securities Identification Procedures). Para el caso de una moneda como activo subyacente se debe informar el código definido en SEIL, codificación S.V.S., Unidades Monetarias. Si el activo subyacente es una tasa, si ésta es variable se informará la tasa de interés de referencia del instrumento, por ejemplo Libor 360. Si es un interés fijo se llenará con la tasa fijada. De no existir los anteriores, se deberá consultar a esta Superintendencia.	X(30)

ACTIVO_OBJETO (unidades)	<p>Corresponde al número de unidades del activo subyacente de cada contrato.</p> <p>En caso de: Opción sobre moneda, corresponde al monto en moneda extranjera establecido por contrato que se tiene derecho a recibir o entregar a la fecha de ejercicio.</p> <p>En caso de opción sobre tasa o renta fija, corresponde al valor notional sobre el cual se calculan los flujos que se tienen derecho a recibir o entregar a la fecha de ejercicio, o bien al valor presente del instrumento de renta fija establecido por contrato que se tiene derecho a recibir o entregar a la fecha de ejercicio.</p> <p>En caso de opción sobre acción o índice accionario, corresponde a la cantidad de acciones que se tiene derecho a recibir o entregar a la fecha de ejercicio. En caso de índices accionarios, corresponde al valor de mercado del índice al cierre de los Estados Financieros que se tiene derecho a recibir o entregar a la fecha de ejercicio.</p>	9(13)V9(03)
MONEDA	<p>Corresponde a la moneda en la cual está denominado el derivado, cuando corresponda. Se informará de acuerdo a la codificación definida en el sitio web de esta Superintendencia en el módulo SEIL, Codificación SVS, Unidad Monetaria. De no existir, se deberá consultar a esta Superintendencia.</p>	X(06)
PRECIO_DE_EJERCICIO	<p>Precio de intercambio a futuro fijado en el contrato, por una unidad del activo subyacente. Debe ser expresado en la moneda en la cual está denominado el derivado.</p>	9(10)V9(03)
PRECIO_SPOT_DEL_ACTIVOSUBYACENTE	<p>Corresponde al precio de cierre observado del activo subyacente a la opción, a la fecha de la información.</p> <p>En caso de Opción sobre moneda, corresponde al valor de la moneda en el mercado contado a la fecha de información.</p> <p>En caso de Opción sobre tasa o renta fija, corresponde a la tasa vigente en el mercado o al valor de mercado del instrumento de renta fija a la fecha de información.</p> <p>En caso de Opción sobre acción o índice accionario, corresponde al valor bursátil de la acción o índice accionario, en el mercado contado a la fecha de información.</p> <p>Debe ser expresado en la moneda en la cual está denominado el derivado.</p>	9(10)V9(03)
PRIMA_DE_LA OPCION (monto)	<p>Corresponde informar el valor pagado o recibido por la suscripción de la opción.</p>	9(13)V9(03)
PRIMA_DE_LA OPCION (moneda)	<p>Corresponde informar la moneda en que se encuentra expresada la prima de la opción, de acuerdo a la codificación definida en SEIL, Codificación SVS, Unidades Monetarias.</p>	X(06)
VALOR_RAZONABLE_DEL_ACTIVOSUBYACENTE_A_LA_FECHA_DE INFORMACION (monto)	<p>Corresponde informar el precio spot del activo objeto a la fecha de información multiplicado por el número de unidades del activo subyacente de cada contrato (M\$).</p>	9(13)
NUMERO_DE CONTRATOS	<p>Corresponde informar el número de contratos comprados o vendidos en cada operación.</p>	9(06)
VALOR_DE_LA OPCION_A_LA_FECHA_DE INFORMACION	<p>Corresponde al valor razonable de la opción, a la fecha de cierre del mes a que se refiere la información (M\$).</p>	-9(12)
ORIGEN_DE_LA INFORMACION	<p>Corresponde a la fuente de donde se obtuvieron los datos para valorizar el contrato.</p>	X(30)

<p>ACTIVO_ RESPALDA_ RESERVA_VALOR_DE_ FONDO</p>	<p>Corresponde informar si uno o más títulos (en caso de haber agrupado instrumentos con características idénticas) registrados, se encuentran respaldando la reserva de valor del fondo señalada en el DFL N°251.</p> <p>Se informará de acuerdo a la valorización que tengan los títulos, según Circular N°1360 y posteriores modificaciones, con un código de cinco letras formado de la siguiente manera:</p> <p>Las tres primeras letras serán:</p> <p>APV : si los instrumentos respaldan la reserva de valor del fondo de seguros con ahorro previsional voluntario, o</p> <p>OTR : si los instrumentos respaldan la reserva de valor del fondo de seguros con ahorro, distinto a los seguros con ahorro previsional voluntario.</p> <p>La cuarta letra será A, B, C o D dependiendo de la forma de constitución de la reserva de descalce a que se refiere el N°4 de la Norma de Carácter General N°132, de 13 de marzo de 2002 y sus posteriores modificaciones.</p> <p>La quinta letra será G si se garantiza la rentabilidad del valor de la póliza en los casos B, C o D, si no corresponde se informará con espacio.</p> <p>Si el instrumento no respalda reserva de valor del fondo se indicará:</p> <p>VIDA: Para activos que NO estén asociados a fondos que respalden seguros de vida con cuenta de inversión y correspondan a inversiones de compañías del segundo grupo</p> <p>GRAL: Para activos que correspondan a inversiones del primer grupo.</p>	<p>X(05)</p>
<p>NOMBRE_DEL_ FONDO</p>	<p>Para instrumentos que estén asociados a fondos que respalden seguros de vida con cuenta de inversión, se debe informar el 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 instrumentos que no respalden seguros de vida con cuenta de inversión, se debe informar "NO APLICA".</p>	<p>X(30)</p>
<p>NOMBRE_CARTERA</p>	<p>Para instrumentos que no respalden seguros de vida con cuenta de inversión, se debe informar la sub cartera que respalda, si corresponde.</p> <p>Para instrumentos que no respalden una sub cartera, se debe informar "NO APLICA"</p>	<p>X(30)</p>
<p>MONTO_ACTIVOS_EN_ MARGEN</p>	<p>Se deberá informar el valor final, a la fecha de información, de los activos entregados como margen en la operación, expresado en miles de pesos (M\$).</p> <p>Si para la operación no es necesario dejar activos en margen indicar cero.</p>	<p>9(13)</p>
<p>MONTO (activo)</p>	<p>Corresponde informar el monto contabilizado en activos producto de este contrato, es decir, el producto entre el valor de la opción a la fecha de la información y el número de contratos. Este monto se deberá expresar en miles de pesos (M\$).</p>	<p>9(13)</p>
<p>MONTO (pasivo)</p>	<p>Corresponde informar el monto contabilizado en pasivos producto de este contrato, es decir, el producto entre el valor de la opción a la fecha de la información y el número de contratos. Este monto se deberá expresar en miles de pesos (M\$).</p>	<p>9(13)</p>
<p>EFFECTO_EN_ RESULTADOS_</p>	<p>Corresponde informar el efecto realizado en los resultados de las operaciones a la fecha de los estados financieros. Este monto se</p>	<p>-9(13)</p>

REALIZADOS	deberá expresar en miles de pesos (M\$).	
TSA	Corresponde informar si el instrumento está incluido en el Test de Suficiencia de Activos para el periodo informado, de acuerdo a la siguiente codificación: SI: el instrumento es utilizado para el análisis del Test de Suficiencia de Activos NO: el instrumento no es utilizado para el análisis del Test de Suficiencia de Activos. En periodos que no corresponde enviar el Test de Suficiencia de Activos	X(02)
FILLER	Se deberá informar espacios.	X(49)

Registro tipo 3 DETALLE

INFORMACIÓN GENERAL DE IDENTIFICACIÓN DE LOS CONTRATOS DE FORWARDS

<u>CAMPO</u>	<u>DESCRIPCION</u>	<u>PICTURE</u>
TIPO	Tipo de registro. En este caso corresponde tipo "3".	9(01)
OBJETIVO_CONTRATO	Corresponde informar el objetivo del contrato derivado, de acuerdo a lo señalado en la NCG N°200 de fecha 07.08.2006 Se señalará de acuerdo a la siguiente codificación: INV : Inversión CBE : Cobertura de Riesgos Financieros 1512 : Cobertura1512, para aquellos contratos que apliquen lo dispuesto en el título VII de la Circular N° 1512 del 2001 referida al calce.	X(05)
TIPO_OPERACION	Código que identifica las operaciones informadas por la compañía, deben informarse todas las operaciones vigentes a la fecha de presentación de la información. Se informará de acuerdo a la codificación definida en la página web de esta Superintendencia en el módulo SEIL, Codificación S.V.S., Instrumentos.	X(10)
FOLIO_OPERACION	Corresponde al número de la papeleta de la mesa de dinero de la compañía, donde se registra la compra del instrumento derivado. En caso de no poder obtener este número se deberá asociar al documento contable que respalda la compra del instrumento.	9(10)
ITEM_OPERACION	Secuencia del instrumento derivado dentro del folio de la operación. No pueden existir dos instrumentos derivados con igual folio e ítem operación.	9(03)
FECHA_DE_LA_OPERACION	Corresponde informar la fecha de inicio del contrato con el siguiente formato: AAAAMMDD.	9(08)
FECHA_DE_VENCIMIENTO_DEL_CONTRATO	Corresponde informar la fecha de término del contrato con el siguiente formato: AAAAMMDD.	9(08)
NOMBRE	Corresponde informar el nombre o razón social de la contraparte de la operación. Para el caso de las operaciones realizadas con bancos nacionales se informará de acuerdo a codificación definida en Seil, Codificación SVS, Códigos Circular 1835, Códigos de Bancos, Nombre del Banco para C.1835	X(60)
NACIONALIDAD	Corresponde informar la nacionalidad de la contraparte de la operación, de acuerdo a la codificación definida en SEIL, Codificación SVS, Países.	X(02)
RELACIONADO	Corresponde informar si la contraparte de la operación está relacionada con la compañía de seguros. Se señalará de acuerdo a	X(02)

	<p>la siguiente codificación:</p> <p>RE : Relacionado NR : No Relacionado</p>	
CLASIFICACION_ DE_RIESGO	<p>Corresponde informar la menor clasificación de riesgo vigente de la contraparte de la operación.</p> <p>Si la contraparte no contara con clasificación de riesgo se debe informar S/C.</p>	X(15)
ACTIVO_ RESPALDA_ RESERVA_VALOR_DE_ FONDO	<p>Corresponde informar si uno o más títulos (en caso de haber agrupado instrumentos con características idénticas) registrados, se encuentran respaldando la reserva de valor del fondo señalada en el DFL N°251.</p> <p>Se informará de acuerdo a la valorización que tengan los títulos, según Circular N°1360 y posteriores modificaciones, con un código de cinco letras formado de la siguiente manera:</p> <p>Las tres primeras letras serán:</p> <p>APV : si los instrumentos respaldan la reserva de valor del fondo de seguros con ahorro previsional voluntario, o</p> <p>OTR : si los instrumentos respaldan la reserva de valor del fondo de seguros con ahorro, distinto a los seguros con ahorro previsional voluntario.</p> <p>La cuarta letra será A, B, C o D dependiendo de la forma de constitución de la reserva de descalce a que se refiere el N°4 de la Norma de Carácter General N°132, de 13 de marzo de 2002 y sus posteriores modificaciones.</p> <p>La quinta letra será G si se garantiza la rentabilidad del valor de la póliza en los casos B, C o D, si no corresponde se informará con espacio.</p> <p>Si el instrumento no respalda reserva de valor del fondo se indicará:</p> <p>VIDA: Para activos que NO estén asociados a fondos que respalden seguros de vida con cuenta de inversión y correspondan a inversiones de compañías del segundo grupo</p> <p>GRAL: Para activos que correspondan a inversiones del primer grupo.</p>	X(05)
NOMBRE_DEL_ FONDO	<p>Para instrumentos que estén asociados a fondos que respalden seguros de vida con cuenta de inversión, se debe informar el 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 instrumentos que no respalden seguros de vida con cuenta de inversión, se debe informar "NO APLICA".</p>	X(30)
NOMBRE_CARTERA	<p>Para instrumentos que no respalden seguros de vida con cuenta de inversión, se debe informar la sub cartera que respalda, si corresponde.</p> <p>Para instrumentos que no respalden una sub cartera, se debe informar "NO APLICA"</p>	X(30)
ACTIVO_OBJETO_ POSICION_LARGA (nombre)	<p>Corresponde informar el activo objeto en la cual está expresada la posición larga en el contrato forward.</p> <p>Se debe informar el código nemotécnico del instrumento, ya sea de acuerdo a lo instruido en la Circular 1085, o la que la reemplace, de esta Superintendencia, o el código asignado según lo señalado en</p>	X(30)

	<p>Anexo N° 1 de la presente Circular aquel asignado por las entidades bursátiles o el código universal "ISIN" (International Securities Identification Number), a falta de éste, el código "CUSIP" (Committee On Uniform Securities Identification Procedures).</p> <p>Para el caso de una moneda como activo subyacente se debe informar el código definido en SEIL, codificación S.V.S., Unidades Monetarias.</p> <p>Si el activo subyacente es una tasa, si ésta es variable se informará la tasa de interés de referencia del instrumento, por ejemplo Libor 360. Si es un interés fijo se llenará con la tasa fijada.</p> <p>De no existir los anteriores, se deberá consultar a esta Superintendencia.</p>	
ACTIVO_OBJETO_POSICIÓN_CORTA_(nombre)	<p>Corresponde informar el activo objeto en la cual está expresada la posición corta en el contrato forward.</p> <p>Se debe informar el código nemotécnico del instrumento, ya sea de acuerdo a lo instruido en la Circular 1085, o la que la reemplace, de esta Superintendencia, o el código asignado según lo señalado en Anexo N° 1 de la presente Circular, aquel asignado por las entidades bursátiles o el código universal "ISIN" (International Securities Identification Number), a falta de éste, el código "CUSIP" (Committee On Uniform Securities Identification Procedures).</p> <p>Para el caso de una moneda como activo subyacente se debe informar el código definido en SEIL, codificación S.V.S., Unidades Monetarias.</p> <p>Si el activo subyacente es una tasa, si ésta es variable se informará la tasa de interés de referencia del instrumento, por ejemplo Libor 360. Si es un interés fijo se llenará con la tasa fijada.</p> <p>De no existir los anteriores, se deberá consultar a esta Superintendencia.</p>	X(30)
ACTIVO_OBJETO_POSICIÓN_LARGA_(unidades)	<p>Corresponde informar el número de unidades del activo subyacente en el cual esta expresada la posición larga de cada contrato.</p> <p>En caso de tratarse de un forward de moneda, corresponde informar el monto en moneda extranjera establecido por contrato que debe ser intercambiado en una fecha futura de acuerdo a la posición en el contrato.</p> <p>Para forward de tasa o renta fija corresponde informar el valor nominal o valor presente del instrumento de renta fija o el flujo, establecido por contrato a ser intercambiado en una fecha futura. Debe informarse en la moneda establecida en el contrato.</p> <p>En el caso de forward de acción, corresponde informar la cantidad de acciones objeto del contrato. Para índices accionarios, corresponde informar el valor monetario de cada punto del índice objeto del contrato multiplicado por el número de unidades del índice que se intercambian, de acuerdo al número de contratos.</p>	9(13)V9(03)
ACTIVO_OBJETO_POSICIÓN_CORTA_(unidades)	<p>Corresponde informar el número de unidades del activo subyacente en el cual esta expresada la posición corta de cada contrato</p> <p>En caso de tratarse de un forward de moneda, corresponde informar el monto en moneda extranjera establecido por contrato que debe ser intercambiado en una fecha futura de acuerdo a la posición en el contrato.</p> <p>Para forward de tasa o renta fija corresponde informar el valor nominal o valor presente del instrumento de renta fija o el flujo, establecido por contrato a ser intercambiado en una fecha futura. Debe informarse en la moneda establecida en el contrato.</p> <p>En el caso de forward de acción, corresponde informar la cantidad de acciones objeto del contrato. Para índices accionarios, corresponde informar el valor monetario de cada punto del índice objeto del contrato multiplicado por el número de unidades del índice que se intercambian, de acuerdo al número de contratos.</p>	9(13)V9(03)
MONEDA	<p>Corresponde a la moneda en la cual expresada la posición de la compañía en el contrato. Se informará de acuerdo a la codificación definida en el sitio web de esta Superintendencia en el módulo SEIL, Codificación SVS, Unidades Monetarias. De no existir, se</p>	X(06)

	deberá consultar a esta Superintendencia.	
PRECIO_FORWARD_CONTRATO	Corresponde informar el precio a futuro establecido en el contrato. En caso de un forward de moneda corresponde informar el valor al cual será intercambiada la moneda de acuerdo a la posición que tenga la compañía en el contrato. Para un forward de tasa o renta fija corresponde informar la tasa o precio que será intercambiada de acuerdo a la posición en el contrato forward. Si se trata de un forward de acción e índice accionario corresponde informar el precio al cual será intercambiada la acción o índice al vencimiento del contrato.	9(10)V9(03)
VALOR_DE_MERCADO_DEL_ACTIV_OBJETO_A_LA_FECHA_DE_INFORMACION (monto)	Corresponde informar el precio spot del activo objeto a la fecha de información multiplicado por el número de unidades del activo subyacente de cada contrato (M\$).	9(13)V9(03)
PRECIO_SPOT_DEL_ACTIV_O SUBYACENTE	Corresponde al precio de cierre observado del activo subyacente al contrato, a la fecha de la información. En caso de forward de moneda corresponde informar el valor de la moneda en el mercado contado a la fecha de información En caso de forward de tasa o renta fija corresponde informar la tasa vigente en el mercado o al valor de mercado del instrumento de renta fija a la fecha de información. En caso de forward de acción e índice accionario corresponde informar el valor bursátil o contado de la acción o índice accionario, en el mercado contado a la fecha de información Debe ser expresado en la moneda en la cual está denominado el derivado.	9(10)V9(03)
PRECIO_FORWARD_MERCADO	Precio forward de mercado a la fecha de valorización, para un contrato de similares características al valorizado, entendiéndose por características del contrato, el activo subyacente y la fecha que le resta al vencimiento desde la fecha de valorización. Este debe ser expresado de acuerdo a la moneda extranjera establecida por contrato a ser entregada o recibida en una fecha futura. Corresponderá al informado por los mercados donde se transaron los respectivos contratos, pudiendo ser obtenido desde medios de información de reconocido prestigio internacional. En caso de no existir dicho valor de mercado, corresponderá al Tipo de cambio spot o de mercado a la fecha de valorización.	9(10)V9(03)
TASA_DESCUENTO_DE_FLUJOS	Corresponde a la tasa de interés real anual de mercado para operaciones similares a plazos equivalentes a la madurez del contrato o a la Tir de compra para los derivados que cubren activos acogidos a la Circular N° 1512.	-9(10)V9(03)
VALOR_RAZONABLE_DEL_CONTRATO_A_LA_FECHA_DE_LA_INFORMACION	Corresponde al valor que presenta el contrato forward a la fecha de información, que se define como el valor actual de la diferencia entre el precio forward de mercado para un contrato de similares características menos el precio forward fijado en el contrato, multiplicado por los nominales del activo objeto que se tiene derecho a comprar o vender. En el caso de derivados que cubran activos acogidos a la Circular N°1.512, corresponde al valor del contrato utilizando la TIR de Compra, multiplicado por los nominales del activo objeto que se tiene derecho a comprar o vender (M\$).	-9(13)
ORIGEN_DE_LA_INFORMACION	Corresponde a la fuente de donde se obtuvieron los datos para valorizar el contrato.	X(30)
MONTO_ACTIVOS_EN_MARGEN	Se deberá informar el valor final, a la fecha de información, de los activos entregados como margen en la operación, expresado en miles de pesos (M\$). Si para la operación no es necesario dejar activos en margen indicar cero.	9(13)

MONTO (activo)	Corresponde informar el monto contabilizado en activos producto de este contrato. Este monto se deberá expresar en miles de pesos (M\$).	9(13)
MONTO (pasivo)	Corresponde informar el monto contabilizado en pasivos producto de este contrato. Este monto se deberá expresar en miles de pesos (M\$).	9(13)
EFFECTO_EN_RESULTADOS_REALIZADOS	Corresponde informar el efecto realizado en los resultados de las operaciones a la fecha de los estados financieros. Este monto se deberá expresar en miles de pesos (M\$).	-9(13)
TSA	Corresponde informar si el instrumento está incluido en el Test de Suficiencia de Activos para el periodo informado, de acuerdo a la siguiente codificación: SI: el instrumento es utilizado para el análisis del Test de Suficiencia de Activos NO: el instrumento no es utilizado para el análisis del Test de Suficiencia de Activos. En periodos que no corresponde enviar el Test de Suficiencia de Activos	X(02)
FLLER	Se deberá informar espacios.	X(28)

Registro tipo 4 DETALLE

INFORMACIÓN GENERAL DE IDENTIFICACIÓN DE LOS CONTRATOS DE FUTUROS

<u>CAMPO</u>	<u>DESCRIPCION</u>	<u>PICTURE</u>
TIPO	Tipo de registro. En este caso corresponde tipo "4".	9(01)
OBJETIVO_CONTRATO	Corresponde informar el objetivo del contrato derivado, de acuerdo a lo señalado en la NCG N°200 de fecha 07.08.2006. Se señalará de acuerdo a la siguiente codificación: INV : Inversión CBE : Cobertura de Riesgos Financieros	X(3)
TIPO_OPERACION	Código que identifica las operaciones informadas por la compañía, deben informarse todas las operaciones vigentes a la fecha de presentación de la información. Se informará de acuerdo a la codificación definida en la página web de esta Superintendencia en el módulo SEIL, Codificación S.V.S., Instrumentos.	X(10)
FOLIO_OPERACION	Corresponde al número de la papeleta de la mesa de dinero de la compañía, donde se registra la compra del instrumento derivado. En caso de no poder obtener este número se deberá asociar al documento contable que respalda la compra del instrumento.	9(10)
ITEM_OPERACION	Secuencia del instrumento derivado dentro del folio de la operación. No pueden existir dos instrumentos derivados con igual folio e ítem operación.	9(03)
FECHA_DE_LA_OPERACION	Corresponde informar la fecha de compra de la operación con el siguiente formato: AAAAMMDD.	9(08)
FECHA_DE_VENCIMIENTO_DEL_CONTRATO	Corresponde informar la fecha de vencimiento del contrato con el siguiente formato: AAAAMMDD.	9(08)
NOMBRE	Corresponde informar el nombre o razón social de la contraparte de la operación. Para el caso de las operaciones realizadas con bancos	X(60)

	nacionales se informará de acuerdo a codificación definida en Seil, Codificación SVS, Códigos Circular 1835, Códigos de Bancos, Nombre del Banco para C.1835	
NACIONALIDAD	Corresponde informar la nacionalidad de la contraparte de la operación, de acuerdo a la codificación definida en SEIL, Codificación SVS, países.	X(02)
RELACIONADO	Corresponde informar si la contraparte de la operación está relacionada con la compañía de seguros. Se señalará de acuerdo a la siguiente codificación: RE : Relacionado NR : No Relacionado	X(02)
CLASIFICACION_ DE_RIESGO	Corresponde informar la menor clasificación de riesgo vigente de la contraparte de la operación. Si la contraparte no contara con clasificación de riesgo se debe informar S/C.	X(15)
ACTIVO_ RESPALDA_ RESERVA_VALOR_DE_ FONDO	Corresponde informar si uno o más títulos (en caso de haber agrupado instrumentos con características idénticas) registrados, se encuentran respaldando la reserva de valor del fondo señalada en el DFL N°251. Se informará de acuerdo a la valorización que tengan los títulos, según Circular N°1360 y posteriores modificaciones, con un código de cinco letras formado de la siguiente manera: Las tres primeras letras serán: APV : si los instrumentos respaldan la reserva de valor del fondo de seguros con ahorro previsional voluntario, o OTR : si los instrumentos respaldan la reserva de valor del fondo de seguros con ahorro, distinto a los seguros con ahorro previsional voluntario. La cuarta letra será A, B, C o D dependiendo de la forma de constitución de la reserva de descalce a que se refiere el N°4 de la Norma de Carácter General N°132, de 13 de marzo de 2002 y sus posteriores modificaciones. La quinta letra será G si se garantiza la rentabilidad del valor de la póliza en los casos B, C o D, si no corresponde se informará con espacio. Si el instrumento no respalda reserva de valor del fondo se indicará: VIDA: Para activos que NO estén asociados a fondos que respalden seguros de vida con cuenta de inversión y correspondan a inversiones de compañías del segundo grupo GRAL: Para activos que correspondan a inversiones del primer grupo.	X(05)
NOMBRE_DEL_ FONDO	Para instrumentos que estén asociados a fondos que respalden seguros de vida con cuenta de inversión, se debe informar el 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. Para instrumentos que no respalden seguros de vida con cuenta de inversión, se debe informar "NO APLICA".	X(30)
NOMBRE_CARTERA	Para instrumentos que estén asociados a fondos que respalden seguros de vida con cuenta de inversión, se debe informar la sub cartera que respalda, si corresponde. Para instrumentos que no respalden seguros de vida con cuenta de	X(30)

	inversión, se debe informar "NO APLICA".	
ACTIVO_OBJETO_POSICION_LARGA (nombre)	<p>Corresponde informar el activo objeto en la cual está expresada la posición larga en el contrato futuro.</p> <p>Se debe informar el código nemotécnico del instrumento, ya sea de acuerdo a lo instruido en la Circular 1085, o la que la reemplace, de esta Superintendencia o el código asignado según lo señalado en Anexo N° 1 de la presente Circular o aquel asignado por las entidades bursátiles o el código universal "ISIN" (International Securities Identification Number), a falta de éste, el código "CUSIP" (Committee On Uniform Securities Identification Procedures).</p> <p>Para el caso de una moneda como activo subyacente se debe informar el código definido en SEIL, codificación S.V.S., Unidades Monetarias.</p> <p>Si el activo subyacente es una tasa, si ésta es variable se informará la tasa de interés de referencia del instrumento, por ejemplo Libor 360. Si es un interés fijo se llenará con la tasa fijada.</p> <p>De no existir los anteriores, se deberá consultar a esta Superintendencia.</p>	X(30)
ACTIVO_OBJETO_POSICION_CORTA_(no mbre)	<p>Corresponde informar el activo objeto en la cual está expresada la posición corta en el contrato futuro.</p> <p>Se debe informar el código nemotécnico del instrumento, ya sea de acuerdo a lo instruido en la Circular 1085, o la que la reemplace, de esta Superintendencia o el código asignado según lo señalado en Anexo N° 1 de la presente Circular o aquel asignado por las entidades bursátiles o el código universal "ISIN" (International Securities Identification Number), a falta de éste, el código "CUSIP" (Committee On Uniform Securities Identification Procedures).</p> <p>Para el caso de una moneda como activo subyacente se debe informar el código definido en SEIL, codificación S.V.S., Unidades Monetarias.</p> <p>Si el activo subyacente es una tasa, si ésta es variable se informará la tasa de interés de referencia del instrumento, por ejemplo Libor 360. Si es un interés fijo se llenará con la tasa fijada.</p> <p>De no existir los anteriores, se deberá consultar a esta Superintendencia.</p>	X(30)
ACTIVO_OBJETO_POSICION_LARGA (unidades)	<p>Corresponde informar el número de unidades del activo subyacente en el cual esta expresada la posición larga de cada contrato.</p> <p>En caso de tratarse de un futuro de moneda, corresponde informar el monto en moneda extranjera establecido por contrato que debe ser intercambiado en una fecha futura de acuerdo a la posición en el contrato.</p> <p>Para futuro de tasa o renta fija corresponde informar el valor nocional o valor presente del instrumento de renta fija o el flujo, establecido por contrato a ser intercambiado en una fecha futura. Debe informarse en la moneda establecida en el contrato.</p> <p>En el caso de futuro de acción, corresponde informar la cantidad de acciones objeto del contrato. Para índices accionarios, corresponde informar el valor monetario de cada punto del índice objeto del contrato multiplicado por el número de unidades del índice que se intercambian, de acuerdo al número de contratos.</p>	9(13)V9(03)
ACTIVO_OBJETO_POSICION_CORTA (unidades)	<p>Corresponde informar el número de unidades del activo subyacente en el cual esta expresada la posición corta de cada contrato</p> <p>En caso de tratarse de un futuro de moneda, corresponde informar el monto en moneda extranjera establecido por contrato que debe ser intercambiado en una fecha futura de acuerdo a la posición en el contrato.</p> <p>Para futuro de tasa o renta fija corresponde informar el valor nocional o valor presente del instrumento de renta fija o el flujo, establecido por contrato a ser intercambiado en una fecha futura. Debe informarse en la moneda establecida en el contrato.</p>	9(13)V9(03)

	En el caso de futuro de acción, corresponde informar la cantidad de acciones objeto del contrato. Para índices accionarios, corresponde informar el valor monetario de cada punto del índice objeto del contrato multiplicado por el número de unidades del índice que se intercambian, de acuerdo al número de contratos.	
MONEDA	Corresponde a la moneda en la cual está expresada la posición de la compañía en el contrato. Se informará de acuerdo a la codificación definida en el sitio web de esta Superintendencia en el módulo SEIL, Codificación SVS, Unidades Monetarias. De no existir, se deberá consultar a esta Superintendencia.	X(06)
NUMERO_DE_CONTRATOS	Corresponde informar el número de contratos comprados o vendidos en cada operación.	9(06)
VALOR_DE_MERCADO_DEL_ACTIVIO OBJETO_A_LA_FECHA_DE_INFORMACION (monto)	Corresponde informar el valor de mercado del activo objeto a la fecha de información multiplicado por el número de unidades del activo subyacente de cada contrato, multiplicado por el número de contratos (M\$).	9(13)
PRECIO_SPOT_DEL_ACTIVIO SUBYACENTE	Corresponde al precio de cierre observado del activo subyacente al contrato, a la fecha de la información. En caso de futuro de moneda corresponde informar el valor de la moneda en el mercado contado a la fecha de información En caso de futuro de tasa o renta fija corresponde informar la tasa vigente en el mercado o al valor de mercado del instrumento de renta fija a la fecha de información. En caso de forward de acción e índice accionario corresponde informar el valor bursátil o contado de la acción o índice accionario, en el mercado contado a la fecha de información Debe ser expresado en la moneda en la cual está denominado el derivado.	9(10)V9(03)
PRECIO_FUTURO_DE_MERCADO_AL_INICIO_DE_LA_OPERACION	Corresponde al precio futuro de mercado del contrato a la fecha de cierre del trimestre anterior; o bien, a la fecha de inicio de la operación si es que ésta se efectuó durante el trimestre que se está informando.	9(10)V9(03)
PRECIO_FUTURO_DE_MERCADO_A_LA_FECHA_DE_INFORMACION	Corresponde al precio futuro de mercado a la fecha de información, para un contrato de idénticas características. Este debe ser expresado de acuerdo a la moneda extranjera establecida por contrato a ser entregada o recibida en una fecha futura. Corresponderá al informado por los mercados donde se transaron los respectivos contratos, pudiendo ser obtenido desde medios de información de reconocido prestigio internacional. En caso de no existir dicho valor de mercado, corresponderá al Tipo de cambio spot o de mercado a la fecha de valorización.	9(10)V9(03)
ORIGEN_DE_LA_INFORMACION	Corresponde a la fuente de donde se obtuvieron los datos para valorizar el contrato.	X(30)
MONTO_ACTIVOS_EN_MARGEN	Se deberá informar el valor final, a la fecha de información, de los activos entregados como margen en la operación, expresado en miles de pesos (M\$). Si para la operación no es necesario dejar activos en margen indicar cero.	9(13)
MONTO (activo)	Corresponde informar el monto contabilizado en activos producto de este contrato. Este monto se deberá expresar en miles de pesos (M\$).	9(13)
MONTO (pasivo)	Corresponde informar el monto contabilizado en pasivos producto de este contrato. Este monto se deberá expresar en miles de pesos	9(13)

	(M\$).	
EFFECTO_EN_RESULTADOS_REALIZADOS	Corresponde informar el efecto realizado en los resultados de las operaciones a la fecha de los estados financieros. Este monto se deberá expresar en miles de pesos (M\$).	-9(13)
TSA	Corresponde informar si el instrumento está incluido en el Test de Suficiencia de Activos para el periodo informado, de acuerdo a la siguiente codificación: SI: el instrumento es utilizado para el análisis del Test de Suficiencia de Activos NO: el instrumento no es utilizado para el análisis del Test de Suficiencia de Activos. En periodos que no corresponde enviar el Test de Suficiencia de Activos	X(02)
FILLER	Se deberá informar espacios.	X(55)

Registro tipo 5 DETALLE: **INFORMACIÓN GENERAL DE IDENTIFICACIÓN DE LOS CONTRATOS SWAPS**

<u>CAMPO</u>	<u>DESCRIPCION</u>	<u>PICTURE</u>
TIPO	Tipo de registro. En este caso corresponde tipo "5".	9(01)
OBJETIVO_CONTRATO	Corresponde informar el objetivo del contrato derivado, de acuerdo a lo señalado en la NCG N°200 de fecha 07.08.2006. Se señalará de acuerdo a la siguiente codificación: INV : Inversión CBE : Cobertura de riesgos financieros 1512 : Cobertura1512, para aquellos contratos que apliquen lo dispuesto en el Título VII de la Circular N°1512 del 2001 referida a calce.	X(05)
TIPO_OPERACION	Código que identifica las operaciones informadas por la compañía, deben informarse todas las operaciones vigentes a la fecha de presentación de la información. Se informará de acuerdo a la codificación definida en la página web de esta Superintendencia en el módulo SEIL, Codificación S.V.S., Instrumentos.	X(10)
FOLIO_OPERACION	Corresponde al número de la papeleta de la mesa de dinero de la compañía, donde se registra la compra del instrumento derivado. En caso de no poder obtener este número se deberá asociar al documento contable que respalda la compra del instrumento.	9(10)
ITEM_OPERACION	Secuencia del instrumento derivado dentro del folio de la operación. No pueden existir dos instrumentos derivados con igual folio e ítem operación.	9(03)
FECHA_DE_LA_OPERACION	Corresponde informar la fecha de inicio del contrato con el siguiente formato: AAAAMDD.	9(08)
FECHA_DE_VENCIMIENTO_DEL_CONTRATO	Corresponde informar la fecha de vencimiento del contrato con el siguiente formato: AAAAMDD.	9(08)
NOMBRE	Corresponde informar el nombre o razón social de la contraparte de la operación. Para el caso de las operaciones realizadas con bancos nacionales se informará de acuerdo a codificación definida en Seil, Codificación SVS, Códigos Circular 1835, Códigos de Bancos, Nombre del Banco para C.1835	X(60)
NACIONALIDAD	Corresponde informar la nacionalidad de la contraparte de la operación, de acuerdo a la codificación definida SEIL, Codificación SVS, Países.	X(02)

RELACIONADO	Corresponde informar si la contraparte de la operación está relacionada con la compañía de seguros. Se señalará de acuerdo a la siguiente codificación: RE : Relacionado NR : No Relacionado	X(02)
CLASIFICACION_DE_RIESGO	Corresponde informar la menor clasificación de riesgo vigente, si tuviere, de la contraparte de la operación. Si la contraparte no contara con clasificación de riesgo se debe informar S/C.	X(15)
ACTIVO_OBJETO_POSICION_LARGA (monto)	Corresponde al Valor nocional establecido por contrato, que será recibido en una fecha futura por la compañía.	9(13)V9(03)
ACTIVO_OBJETO_POSICION_CORTA (monto)	Corresponde al Valor nocional establecido por contrato, que será entregado en una fecha futura por la compañía.	9(13)V9(03)
MONEDA_POSICION_LARGA	Corresponde a la moneda en la cual está expresada la posición larga en el contrato swap, es decir la moneda en que está denominada la tasa o el nocional, que debe ser recibido en una fecha futura, cuando corresponda. Se informará de acuerdo a la codificación definida en el sitio web de esta Superintendencia en el módulo SEIL, Codificación SVS, Unidades Monetarias. De no existir, se deberá consultar a esta Superintendencia.	X(06)
MONEDA_POSICION_CORTA	Corresponde a la moneda en la cual está expresada la posición corta en el contrato swap, es decir la moneda en que está denominada la tasa o el nocional, que debe ser entregado en una fecha futura, cuando corresponda. Se informará de acuerdo a la codificación definida en el sitio web de esta Superintendencia en el módulo SEIL, Codificación SVS, Unidades Monetarias. De no existir, se deberá consultar a esta Superintendencia.	X(06)
TASA_A_FUTURO_CONTRATO_POSICION_LARGA	Corresponde a la tasa a futuro establecida en el contrato swap la cual generará los flujos a ser recibidos en una fecha futura, cuando corresponda. Ej.: Fija 8,5%, Libor, etc.	X(30)
TASA_A_FUTURO_CONTRATO_POSICION_CORTA	Corresponde a la tasa a futuro establecida en el contrato swap la cual generará los flujos a ser entregados en una fecha futura, cuando corresponda. Ej: Fija 7,4%, Libor, etc.	X(30)
T. C. FUTURO CONTRATO	Corresponde al tipo de cambio a futuro establecido en el contrato swap y deberá ser expresado de acuerdo a la moneda extranjera establecida por contrato a ser entregada o recibida en una fecha futura.	9(10)V9(03)
TASA_A_FUTURO_MERCADO_POSICION_LARGA	Corresponde a la tasa de interés única, que aplicada a cada flujo del swap de la posición larga, genera el mismo valor presente que al valorizar cada flujo usando la estructura cero cupón de mercado a la fecha.	9(10)V9(03)
TASA_A_FUTURO_MERCADO_POSICION_CORTA	Corresponde a la tasa de interés única, que aplicada a cada flujo del swap de la posición corta, genera el mismo valor presente que al valorizar cada flujo usando la estructura cero cupón de mercado a la fecha.	9(10)V9(03)
TIPO_DE_CAMBIO_MERCADO	Tipo de cambio spot de mercado a la fecha de valorización Corresponderá al informado por los mercados donde se transaron los respectivos contratos, pudiendo ser obtenido desde medios de información de reconocido prestigio internacional.	9(10)V9(03)
VALOR_PRESENTE_POSICION_LARGA (M\$)	Corresponde al valor actual de los flujos a recibir descontados a la tasa de mercado posición larga o a Tir de compra según corresponda.	9(13)
VALOR_	Corresponde al valor actual de los flujos a entregar descontados a	9(13)

PRESENTE_POSICION_CORTA (M\$)	la tasa de mercado posición corta o a Tir de compra según corresponda.	
VALOR_RAZONABLE_DEL_ACTIVIO_OBJETO_A_LA_FECHA_DE_LA_INFORMACION (M\$)	Corresponde informar, en caso de: Swaps de monedas: el valor de mercado de la moneda multiplicada por los nominales del contrato Swaps de tasa de interés: el valor presente del notional o de referencia del contrato Swaps sobre instrumento de renta fija: el número de unidades del instrumento o índice por el precio spot a la fecha de la información.	9(13)
VALOR_RAZONABLE_D_EL_CONTRATO_A_LA_FECHA_DE_LA_INFORMACION_(M\$)	Corresponde al valor razonable que presenta el contrato swap, o uno de similares características, a la fecha de información. En el caso de derivados que cubran activos acogidos a la Circular N°1.512, corresponde al valor del contrato utilizando la TIR de compra.	-9(13)
ORIGEN_DE_LA_INFORMACION	Corresponde a la fuente de donde se obtuvieron los datos para valorizar el contrato.	X(30)
ACTIVO_RESPALDA_RESERVA_VALOR_DE_FONDO	Corresponde informar si uno o más títulos (en caso de haber agrupado instrumentos con características idénticas) registrados, se encuentran respaldando la reserva de valor del fondo señalada en el DFL N°251. Se informará de acuerdo a la valorización que tengan los títulos, según Circular N°1360 y posteriores modificaciones, con un código de cinco letras formado de la siguiente manera: Las tres primeras letras serán: APV : si los instrumentos respaldan la reserva de valor del fondo de seguros con ahorro previsional voluntario, o OTR : si los instrumentos respaldan la reserva de valor del fondo de seguros con ahorro, distinto a los seguros con ahorro previsional voluntario La cuarta letra será A, B, C o D dependiendo de la forma de constitución de la reserva de descalce a que se refiere el N°4 de la Norma de Carácter General N°132, de 13 de marzo de 2002 y sus posteriores modificaciones. La quinta letra será G si se garantiza la rentabilidad del valor de la póliza en los casos B, C o D, si no corresponde se informará con espacio. Si el instrumento no respalda reserva de valor del fondo se indicará: VIDA: Para activos que NO estén asociados a fondos que respalden seguros de vida con cuenta de inversión y correspondan a inversiones de compañías del segundo grupo GRAL: Para activos que correspondan a inversiones del primer grupo.	X(05)
NOMBRE_DEL_FONDO	Para instrumentos que estén asociados a fondos que respalden seguros de vida con cuenta de inversión, se debe informar el 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. Para instrumentos que no respalden seguros de vida con cuenta de inversión, se debe informar "NO APLICA".	X(30)

NOMBRE_CARTERA	Para instrumentos que no respalden seguros de vida con cuenta de inversión, se debe informar la sub cartera que respalda, si corresponde. Para instrumentos que no respalden una sub cartera, se debe informar "NO APLICA"	X(30)
MONTO_ACTIVOS_EN_MARGEN	Se deberá informar el valor final, a la fecha de información, de los activos entregados como margen en la operación, expresado en miles de pesos (M\$). Si para la operación no es necesario dejar activos en margen indicar cero.	9(13)
MONTO (activo)	Corresponde informar el monto contabilizado en activos producto de este contrato. Este monto se deberá expresar en miles de pesos (M\$).	9(13)
MONTO (pasivo)	Corresponde informar el monto contabilizado en pasivos producto de este contrato. Este monto se deberá expresar en miles de pesos (M\$).	9(13)
EFFECTO_EN_RESULTADOS_REALIZADOS	Corresponde informar el efecto realizado en los resultados de las operaciones a la fecha de los estados financieros. Este monto se deberá expresar en miles de pesos (M\$).	-9(13)
TSA	Corresponde informar si el instrumento está incluido en el Test de Suficiencia de Activos para el periodo informado, de acuerdo a la siguiente codificación: SI: el instrumento es utilizado para el análisis del Test de Suficiencia de Activos NO: el instrumento no es utilizado para el análisis del Test de Suficiencia de Activos. En periodos que no corresponde enviar el Test de Suficiencia de Activos	X(02)

Registro tipo 6 DETALLE: **INFORMACIÓN GENERAL DE IDENTIFICACIÓN DE LOS CONTRATOS DE PACTOS**

<u>CAMPO</u>	<u>DESCRIPCION</u>	<u>PICTURE</u>
TIPO	Tipo de registro. En este caso corresponde tipo "6".	9(01)
TIPO_OPERACION	Código que identifica las operaciones informadas por la compañía, deben informarse todas las operaciones vigentes a la fecha de presentación de la información. Se informará de acuerdo a la codificación definida en la página web de esta Superintendencia en el módulo SEIL, Codificación S.V.S., Instrumentos.	X(10)
FOLIO_OPERACION	En el caso que la operación corresponda a una retroventa, se debe indicar el número de la papeleta de la mesa de dinero de la compañía, donde se registra la operación subyacente al pacto. Para otro tipo de pacto se debe informar el folio de la operación de pacto. En caso de no poder obtener este número se deberá asociar al documento contable que respalda la compra del instrumento.	9(10)
ITEM_OPERACION	Secuencia dentro del folio de la operación. No pueden existir dos operaciones con igual folio e ítem operación.	9(03)
FECHA_DE_LA_OPERACION	Corresponde informar la fecha de inicio del contrato de pacto con el siguiente formato: AAAAMMDD.	9(08)
FECHA_DE_VENCIMIENTO_DEL_CONTRATO	Corresponde informar la fecha de vencimiento del contrato de pacto con el siguiente formato: AAAAMMDD.	9(08)
TASA_PACTO	Corresponde informar la tasa a la cual fue realizado el pacto, indicada en el contrato de pacto.	9(10)V9(03)

NOMBRE	Corresponde informar el nombre o razón social de la contraparte del pacto. Para el caso de las operaciones realizadas con bancos nacionales se informará de acuerdo a codificación definida en Seil, Codificación SVS, Códigos Circular 1835, Códigos de Bancos, Nombre del Banco para C.1835	X(60)
NACIONALIDAD	Corresponde informar la nacionalidad de la contraparte del pacto, de acuerdo a la codificación definida en SEIL, Codificación SVS, Países.	X(02)
RELACIONADO	Corresponde informar si la contraparte del pacto está relacionada con la compañía de seguros. Se señalará de acuerdo a la siguiente codificación: RE : Relacionado NR : No Relacionado	X(02)
ACTIVO_OBJETO (nombre)	Instrumento subyacente al pacto. En el caso de tratarse de un instrumento de renta fija nacional corresponde obligatoriamente informar el código nemotécnico de acuerdo a lo instruido en la Circular 1085, o la que la reemplace, de esta Superintendencia o el código asignado según lo señalado en Anexo N° 1 de la presente Circular. En el caso de instrumentos financieros de renta fija emitidos por empresas extranjeras o 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). De no existir los anteriores, se deberá consultar a esta Superintendencia.	X(30)
SERIE_ACTIVADO_OBJETO	Corresponde informar la serie del instrumento subyacente al pacto cuando corresponda.	X(30)
NRO_RUT_ACTIVADO_OBJETO	Corresponde informar el Rut del emisor del instrumento subyacente.	9(09)
DIG_RUT_ACTIVADO_OBJETO	Corresponde informar el dígito verificador del RUT del emisor del instrumento subyacente.	X(01)
VALOR_NOMINAL	Corresponde informar el valor nominal del instrumento subyacente a la fecha de presentación de la información. Se entiende por "nominal" los nominales comprados originalmente menos las ventas realizadas sobre este título. No se deberán rebajar las amortizaciones del instrumento a la fecha de información.	9(13)V9(03)
TIR_COMPRA	Corresponde a la tasa anual de descuento utilizada para determinar el precio del instrumento subyacente al momento de la compra.	9(10)V9(03)
TASA_EMISION	Corresponde a la tasa a la cual fue emitido el instrumento subyacente.	9(10)V9(03)
ACTIVO_OBJETO (monto) (M\$)	Corresponde al valor contable del instrumento subyacente al pacto a la fecha de información, según Circular de valorización vigente.	9(13)
MONEDA	Corresponde a la moneda en la cual está denominado el instrumento subyacente el pacto, cuando corresponda. Se informará de acuerdo a la codificación definida en el sitio web de esta Superintendencia en el módulo SEIL, Codificación SVS, Unidades Monetarias. De no existir, se deberá consultar a esta Superintendencia.	X(06)
TASA_O_PRECIO_DE_MERCADO	Tasa de mercado del instrumento subyacente al pacto, a la fecha de valorización.	9(10)V9(03)
VALOR_DE_MERCADO_A_LA_	Corresponde informar el monto del valor de mercado, del activo objeto a la fecha de suscripción del pacto.	9(13)V9(03)

FECHA_DE_SUSCRIPCION (monto)		
VALOR_INICIAL_UM	Corresponde al valor invertido en la operación, indicado en el contrato de pacto, expresado en la moneda del pacto.	9(13)V9(03)
VALOR_PACTADO	Corresponde al valor del pacto al vencimiento, acordado en el contrato de pacto, expresado en la moneda del pacto.	9(13)V9(03)
INTERES_DEVENGADO_DEL_PACTO M\$ (Otros Activos)	Corresponde informar el interés que resulte de aplicar la tasa implícita entre el valor de compra del activo objeto y el monto a recibir por el cumplimiento del compromiso de venta, en proporción al tiempo transcurrido.	9(13)
VALORIZACION_DE_PACTO_A_LA_FECHA_DE_CIERRE	Corresponde informar el valor en que se encuentra contabilizado el pacto, de acuerdo a las instrucciones de circular sobre valorización de esta Superintendencia, a la fecha de cierre del mes a que se refiere la información, expresado en miles de pesos (M\$).	9(13)
VALOR_DE_MERCADO_A_LA_FECHA_DE_INFORMACION (monto) (M\$)	Corresponde informar el monto del valor de mercado, del activo subyacente del pacto, a la fecha de información.	9(13)
TSA	Corresponde informar si el instrumento está incluido en el Test de Suficiencia de Activos para el periodo informado, de acuerdo a la siguiente codificación: SI: el instrumento es utilizado para el análisis del Test de Suficiencia de Activos NO: el instrumento no es utilizado para el análisis del Test de Suficiencia de Activos. En periodos que no corresponde enviar el Test de Suficiencia de Activos	X(02)
FILLER	Se deberá informar espacios.	X(133)

Registro Tipo 7 de TOTALES

<u>CAMPO</u>	<u>DESCRIPCION</u>	<u>PICTURE</u>
TIPO	Tipo de registro. En este caso corresponde "7".	9(01)
TOTAL_REGISTROS	Corresponde al número total de registros informados <u>incluidos</u> el de IDENTIFICACION y el de TOTALES.	9(06)
FILLER	Se deberá informar espacios.	X(476)