



## ANEXO N° 2

### ÍNDICE DE TABLAS

Tabla 1: Naturaleza de la Información
Tabla 2: Eventos de Reporte
Tabla 3: Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente
Tabla 4: Instrumentos
Tabla 5: Clase de Opción
Tabla 6: Tipo de Posición
Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente
Tabla 8: Modalidad de Liquidación
Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés
Tabla 10: Objetivo de la Operación
Tabla 11: Convenio Marco
Tabla 12: Garantías
Tabla 13: Cláusula de Recouponsing
Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado
Tabla 15: Compresión de Cartera
Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía
Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado
Tabla 18: Método de Valorización



## TABLAS

### REGLAMENTO OPERATIVO DEL SISTEMA INTEGRADO DE INFORMACIÓN SOBRE TRANSACCIONES DE DERIVADOS (RO-SIID)

#### Índice

Tabla 1: Naturaleza de la Información .....	2
Tabla 2: Eventos de Reporte .....	2
Tabla 3: Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente.....	2
Tabla 4: Instrumentos .....	3
Tabla 5: Clase de Opción.....	3
Tabla 6: Tipo de Posición.....	3
Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente.....	3
Tabla 8: Modalidad de Liquidación .....	4
Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés .....	4
Tabla 10: Objetivo de la Operación .....	6
Tabla 11: Convenio Marco .....	6
Tabla 12: Garantías .....	6
Tabla 13: Cláusula de <i>Recouponing</i> .....	7
Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado .....	7
Tabla 15: Compresión de Cartera.....	7
Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía.....	7
Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado .....	8
Tabla 18: Método de Valorización .....	8



Tabla 1: Naturaleza de la Información

Descripción
El Evento de Reporte se comunica en cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI, sobre operaciones con instrumentos derivados.
El Evento de Reporte NO se comunica en cumplimiento de la normativa cambiaria antedicha, sino que se ajusta a los demás requerimientos generales previstos en el Capítulo III.D.3 del CNF.

Tabla 2: Eventos de Reporte

Numeral	Descripción
2.1.1	Nuevo contrato
2.1.2	Adquisición por cesión
2.2.1	Modificación por <i>recouping</i>
2.2.2	Modificación de contraparte por cesión
2.2.3	Otras modificaciones
2.2.4	Modificación por corrección de reporte
2.3.1	Término por caducidad, anticipo o resciliación
2.3.2	Término por cesión
2.3.3	Término por anulación
2.3.4	Mensual operaciones vencidas
2.4.1	Mensual operaciones vigentes

Tabla 3: Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente

Descripción
<i>International Securities Identification Number (ISIN)</i>
<i>Nemotécnico</i>
<i>Alternative Instrument Indicator (AII)</i>
<i>Committee on Uniform Securities Identification (CUSIP)</i>
<i>Stock Exchange Daily Official List (SEDOL)</i>
Otro



Tabla 4: Instrumentos

Descripción	Sistema al que aplica
<i>Cross Currency Swap</i>	I (Monedas)
<i>Forward</i> Observado	I (Monedas)
<i>FX Swap</i>	I (Monedas)
Futuro	I, II y III (Monedas, Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente)
<i>Forward</i>	I, II y III (Monedas, Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente)
<i>Swaption</i>	I y II (Monedas y Tasas de Interés, respectivamente)
Opción <i>Call</i>	I (Monedas)
Opción <i>Put</i>	I (Monedas)
Opción <i>Cap</i>	II y III (Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente)
Opción <i>Floor</i>	II y III (Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente)
<i>Interest Rate Swap</i>	II (Tasas de Interés)
Otros	I, II y III (Monedas, Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente)

Tabla 5: Clase de Opción

Descripción
Americana
Bermuda
Europea
Asiática
Otras
No Aplica

Tabla 6: Tipo de Posición

Descripción
Compradora
Vendedora

Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente

Descripción	Sistema al que aplica
<i>Cross Currency Swap</i>	I (Monedas)
<i>Interest Rate Swap</i>	II (Tasas de Interés)



Tabla 8: Modalidad de Liquidación

Descripción
Compensación
Entrega Física

Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés

Descripción
Tasa fija
TAB UF a 90 días
TAB UF a 180 días
TAB UF a 360 días
TAB nominal a 30 días
TAB nominal a 90 días
TAB nominal a 180 días
TAB nominal a 360 días
TADO a 30 días
TADO a 60 días
TADO a 90 días
TADO a 180 días
TADO a 360 días
Tasa nominal anualizada ICP
Tasa real anualizada ICP
<i>Prime Rate</i>
LIBOR en Dólares de los EE.UU <i>overnight</i> (ICE)
LIBOR en Dólares de los EE.UU a 30 días (ICE)
LIBOR en Dólares de los EE.UU a 7 días (ICE)
LIBOR en Dólares de los EE.UU a 60 días (ICE)
LIBOR en Dólares de los EE.UU a 90 días (ICE)
LIBOR en Dólares de los EE.UU a 180 días (ICE)
LIBOR en Dólares de los EE.UU a 360 días (ICE)
SOFR ( <i>Secured Overnight Financing Rate</i> ) de la Reserva Federal de Nueva York
<i>US Federal Funds Effective Rate</i>
<i>United States Overnight Bank Funding Rate</i>
Tasa de la curva de rendimiento del Tesoro de los EE.UU a 10 años
Tasa de la curva de rendimiento del Tesoro de los EE.UU a 3 años
LIBOR en Euros <i>overnight</i> (ICE)
LIBOR en Euros a 7 días (ICE)
LIBOR en Euros a 30 días (ICE)



Descripción
LIBOR en Euros a 60 días (ICE)
LIBOR en Euros a 90 días (ICE)
LIBOR en Euros a 180 días (ICE)
LIBOR en Euros a 360 días (ICE)
ESTER (Euro Short-Term Rate)
Euribor a 1 semana
Euribor a 2 semanas
Euribor a 30 días
Euribor a 60 días
Euribor a 90 días
Euribor a 180 días
Euribor a 270 días
Euribor a 12 meses
EONIA ( <i>Euro Overnight Index Average</i> )
LIBOR en Libras esterlinas overnight (ICE)
LIBOR en Libras esterlinas a 7 días (ICE)
LIBOR en Libras esterlinas a 30 días (ICE)
LIBOR en Libras esterlinas a 60 días (ICE)
LIBOR en Libras esterlinas a 90 días (ICE)
LIBOR en Libras esterlinas a 180 días (ICE)
LIBOR en Libras esterlinas a 360 días (ICE)
SONIA ( <i>Sterling Overnight Interbank Average Rate</i> )
LIBOR en Francos suizos <i>spot next day</i> (ICE )
LIBOR en Francos suizos a 7 días (ICE)
LIBOR en Francos suizos a 30 días (ICE)
LIBOR en Francos suizos a 60 días (ICE)
LIBOR en Francos suizos a 90 días (ICE)
LIBOR en Francos suizos a 180 días (ICE)
LIBOR en Francos suizos a 360 días (ICE)
Libor en Yenes japoneses <i>spot next day</i> (ICE)
Libor en Yenes japoneses a 7 días (ICE)
Libor en Yenes japoneses a 30 días (ICE)
Libor en Yenes japoneses a 60 días (ICE)
Libor en Yenes japoneses a 90 días (ICE)
Libor en Yenes japoneses a 180 días (ICE)
Libor en Yenes japoneses a 360 días (ICE)
Otra tasa variable



Tabla 10: Objetivo de la Operación

Descripción
Negociación
Cobertura de Riesgo de Posiciones del Balance
Cobertura Contable Valor Razonable
Cobertura Contable Flujo de Caja
Cobertura Contable de Inversiones Netas en el Exterior

NOTA: La clasificación de objetivos de la operación de derivados descrita en la tabla anterior, se corresponde con la Norma Internacional de Información Financiera (IFRS). Las categorías de “Negociación” y “Cobertura de Riesgo de Posiciones de Balance” corresponderán a instrumentos financieros derivados, clasificados contablemente para negociación. La categoría “Cobertura de Riesgo de Posiciones de Balance” podrá ser utilizada por bancos y sus filiales que cuenten con la separación de sus mesas de dinero entre la actividad de negociación (trading) y la gestión de activos y pasivos (ALM) y que efectúen coberturas de riesgo de las posiciones del balance que no sean designadas como coberturas contables. Aquellos Participantes que no cuenten con lo anteriormente señalado, deberán informar la totalidad de los instrumentos en la categoría de “Negociación”.

Tabla 11: Convenio Marco

Descripción
Condiciones Generales para Contratos de Derivados en el Mercado Local, aprobadas por la Asociación de Bancos e Instituciones Financieras y reconocidas por el Banco Central de Chile.
<i>International Swaps and Derivatives Association.</i>
Otros convenios no contemplados previamente.
No está sujeto a convenio marco.

Tabla 12: Garantías

Descripción
Completamente caucionado o garantizado: Ambos constituyen Margen Inicial y Margen de Variación
Parcialmente caucionado o garantizado: Solo el Margen de Variación será constituido por alguna de las partes
Solo la Contraparte 1 constituye alguna forma de garantía (Margen Inicial y/o Margen de Variación)
Solo la Contraparte 2 constituye alguna forma de garantía (Margen Inicial y/o Margen de Variación)
Ninguna contraparte constituye garantías
Contraparte Central



Tabla 13: Cláusula de *Recouponing*

Descripción
Con cláusula de <i>Recouponing</i>
Sin cláusula de <i>Recouponing</i>

Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado

Descripción
A favor de la Contraparte 1, con liquidación
A favor de la Contraparte 1, sin liquidación
A favor de la Contraparte 2, con liquidación
A favor de la Contraparte 2, sin liquidación
Opcional ambas partes, con liquidación
Opcional ambas partes, sin liquidación
Sin cláusula de término anticipado

Tabla 15: Compresión de Cartera

Descripción
Contrato es resultado de una compresión de cartera
Contrato no es resultado de una compresión de cartera

Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía

Descripción
Efectivo
Depósitos
Bonos Corporativos
Bonos del Banco Central de Chile
Bonos de la Tesorería General de la República de Chile
Bonos Soberanos Extranjeros
Bonos Corporativos Extranjeros
Acciones
Bienes Inmuebles
Otras garantías



Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado

Descripción
Pago o intercambio de intereses (aplica para entrega física y compensación)
Pago o intercambio de principales (aplica para entrega física y compensación)
Prima o pago realizado al inicio del contrato
Pago originado por el cierre anticipado del contrato
Pago originado por recouping
Otros

Tabla 18: Método de Valorización

Descripción
Valor razonable a precios de mercado ( <i>mark-to-market</i> )
Valor razonable utilizando modelos ( <i>mark-to-model</i> )
Valor razonable calculado por Contraparte Central
Otro



## TABLAS

### REGLAMENTO OPERATIVO DEL SISTEMA INTEGRADO DE INFORMACIÓN SOBRE TRANSACCIONES DE DERIVADOS (RO-SIID)

#### Índice

Tabla 1: Naturaleza de la Información .....	2
Tabla 2: Eventos de Reporte .....	2
Tabla 3: Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente.....	2
Tabla 4: Instrumentos .....	3
Tabla 5: Clase de Opción.....	3
Tabla 6: Tipo de Posición.....	3
Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente.....	3
Tabla 8: Modalidad de Liquidación .....	4
Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés .....	4
Tabla 10: Objetivo de la Operación .....	6
Tabla 11: Convenio Marco .....	6
Tabla 12: Garantías .....	6
Tabla 13: Cláusula de <i>Recouponing</i> .....	7
Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado .....	7
Tabla 15: Compresión de Cartera.....	7
Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía.....	7
Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado .....	8
Tabla 18: Método de Valorización .....	8



Tabla 1: Naturaleza de la Información

Descripción
El Evento de Reporte se comunica en cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos II y IX del CNCI, sobre operaciones con instrumentos derivados.
El Evento de Reporte NO se comunica en cumplimiento de la normativa cambiaria antedicha, sino que se ajusta a los demás requerimientos generales previstos en el Capítulo III.D.3 del CNF.

Tabla 2: Eventos de Reporte

Numeral	Descripción
2.1.1	Nuevo contrato
2.1.2	Adquisición por cesión
2.2.1	Modificación por <i>recouping</i>
2.2.2	Modificación de contraparte por cesión
2.2.3	Otras modificaciones
2.2.4	Modificación por corrección de reporte
2.3.1	Término por caducidad, anticipo o resciliación
2.3.2	Término por cesión
2.3.3	Término por anulación
2.3.4	Mensual operaciones vencidas
2.4.1	Mensual operaciones vigentes

Tabla 3: Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente

Descripción
<i>International Securities Identification Number (ISIN)</i>
<i>Nemotécnico</i>
<i>Alternative Instrument Indicator (AII)</i>
<i>Committee on Uniform Securities Identification (CUSIP)</i>
<i>Stock Exchange Daily Official List (SEDOL)</i>
Otro