

Incorporación derivados sobre Materias Primas al SIID TR

SIID-TR

Sistema Integrado de Información
sobre Transacciones de Derivados

Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (SIID-TR) de Chile

Bancos. Montos transados (MM USD)

 Datos al:
12-03-2024

Spot FX USD/CLP

Compras	Ventas
916	1.022

Derivados FX USD/CLP

Compras	Ventas
2.066	2.170

Bancos. Montos vigentes netos (MM USD)

Derivados FX USD/CLP

No residentes	Residentes no bancos
-16.312	12.872

Bienvenidos al SIID-TR

El Banco Central de Chile, en ejercicio de sus competencias legales, incluyendo el ejercicio de su potestad normativa, ha emitido una regulación (Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras) y desarrollado el Sistema Integrado de Información sobre transacciones de Derivados ("SIID" o "SIID-TR") que opera como un repositorio de derivados siguiendo las mejores prácticas y recomendaciones internacionales para un TR, y por lo tanto adhiriendo a los PFMIs que le resulten aplicables.

A esta infraestructura de mercado deben reportar las personas residentes o domiciliados en Chile (Participantes del SIID), quienes corresponden a bancos, sus Filiales, y otras entidades fiscalizadas por la Comisión para el Mercado Financiero (CMF), así como todos aquellos que realicen transacciones de derivados con no residentes, sobre tipos de cambios, unidades de fomento, tasas de interés y renta fija, de acuerdo a las normas establecidas en el Capítulo III.D.1 del Compendio de Normas Financieras del BCCh y en su correspondiente Reglamento Operativo, los cuales contienen

Novedades


[Ver todas las noticias](#)

El SIID TR es una infraestructura del mercado de derivados financieros en Chile

Esta infraestructura tiene por objetivo:

- Contribuir a la transparencia de mercado
- Promover la estabilidad financiera
- Prevenir abusos de mercado

Contamos con una página web (www.siid.cl) que busca difundir temas relacionados al repositorio: normativa, estadísticas, notas técnicas, etc.

Desde 2022, el Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras exige el reporte de operaciones de derivados sobre tipos de cambio, inflación, tasas de interés y renta fija.

En línea con los estándares internacionales de los TR, durante enero de 2024 el Cap. III.D.3 se modificó para incorporar al reporte la información de derivados sobre **Materias Primas y Renta Variable**.

Dado esto, el reporte enviado mediante el Compendio de Normas de Cambio Internacionales (CNCI) será reemplazado por las nuevas exigencias dispuestas en el reporte al SIID a partir de 2026.

Enero 2024
Acuerdo
consejo:
modifica III.D.3
del CNF y RO
del SIID

Enero 2025
Inicio marcha
blanca de
reportes al SIID

Enero 2026
Entrada en
régimen del
reporte al SIID TR

Carta Circular 717 – Durante 2023 emitió una Carta Circular donde se indicaba que los reportantes al SIID deben designar a una contraparte para mejorar la coordinación entre el Banco Central y la institución.

Señor Gerente:

Considerando la necesidad de propiciar la coordinación entre la entidad que usted representa con el Banco Central de Chile (BCCh), y a fin de resguardar la calidad y oportunidad de la información que debe ser entregada en forma periódica por su entidad al SIID, le agradeceré designar a un gerente, ejecutivo principal u otro profesional con facultades o responsabilidades equivalentes como contraparte del BCCh, con el propósito coordinar la entrega de información de su entidad al Banco. Asimismo, le solicitamos designar a un alterno a dicho representante para asegurar la continuidad de la coordinación.

Esperamos nos pueda comunicar dicha designación con anterioridad al día 15 de octubre de 2023, a través del correo de contacto SIIDerivados@bcentral.cl, mediante comunicación dirigida a la Gerencia de División Estadísticas y Datos, indicando el nombre, cargo, correo electrónico y teléfono de contacto de la contraparte y su alterno.

Finalmente, agradecemos su colaboración, lo que va a permitir seguir avanzando en la transparencia del mercado de derivados de Chile, mediante publicaciones estadísticas y de informes periódicos, los que invitamos a visitar en el sitio web www.siid.cl.

El reporte de Materias Primas (CM, como abreviatura del concepto *commodity*) contará con 7 registros, de los cuales 3 serán de periodicidad diaria y la totalidad de los registros deberá ser enviada en un reporte mensual para los contratos vigentes.

Normativa (RO-SIID)			Tipo de reporte, según periodicidad			
Sección	Nombre	Sistema o subyacente	Tipo de registro	Diario	Mensual	
					Vigente	Vencido
1.A: Información general		FX-IR-FI-CM-EQ	01			
		FX-IR-FI-CM-EQ	02			
		FX-IR-FI-CM-EQ	03			
1.B: Calendario de flujos		FX-IR	04			
2: Pagos del periodo		FX-IR-FI-CM-EQ	05			
3: Garantías		FX-IR-FI-CM-EQ	06			
		FX-IR-FI-CM-EQ	07			
4: Valor de mercado		FX-IR-FI-CM-EQ	08			



Reporte diario: se deberá enviar las nuevas operaciones durante el día y las modificaciones a las condiciones de los contratos. El plazo de envío es hasta las 10 AM del día siguiente. **Solo los bancos deben cumplir con esta periodicidad.**



Reporte mensual: se deberá enviar la cartera vigente al cierre del mes y los contratos vencidos durante el mes. Tanto **bancos como empresas** deberán hacer envío de esta información dentro de los 5 primeros días hábiles de cada mes.

Registro 1: principalmente contempla información relacionada a identificar a los participantes de cada contrato

	Campos
Campos llave	RUT Participante (Contraparte 1)
	Identificador del Contrato
	Fecha y hora de suscripción del contrato
	Identificador de operaciones estructuradas
	Naturaleza de la información
	Evento de Reporte
	LEI contraparte 1
Identificación contraparte 2	RUT contraparte del participante (Contraparte 2)
	LEI contraparte 2
	Nombre o razón social contraparte 2
	País Contraparte 2
Identificación Contraparte Central	RUT de Entidad de Contraparte Central
	LEI de Entidad de Contraparte Central

	Campos
Identificación Agente Liquidador	RUT Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1
	LEI Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1
Identificación Agente cálculo	RUT Agente de Cálculo
	LEI Agente de Cálculo
	Nombre o Razón Social Agente de Cálculo
	RUT del Cedente o Cesionario
	LEI Cedente o Cesionario
Identifica si la operación es OTC	Plataforma de Negociación
	RUT Intermediario
	LEI Intermediario

Registro 2: contempla información financiera general del contrato

	Campos
Campos llave	RUT Participante (Contraparte 1)
	Identificador del Contrato
	Fecha y hora de suscripción del Contrato
	Identificador de Operaciones Estructuradas
	Instrumento
	Identificador del contrato para agente autorizado
Uso de Opciones	Opciones: Clase
	Opciones: Posición en la operación
Identificador del subyacente	Materia prima
	Modalidad de liquidación
	Moneda de compensación

Descripción	Código
Metales	
Aluminio	ALUMN
Cobre	COBRE
Hierro	HIERR
Oro	XAU00
Molibdeno	MLBDN
Plata	XAG00
Energía	
Brent Oil	BROIL
Carbón	CARBN
Fuel Oil 3.5	FUOIL
Gas propano	GASPR
Heating Oil	HEOIL
Jet Fuel	JETFU
Singapore Fuel Oil 380	SINFO
Agrícola	
Cacao	CACAO
Café arábica	CAFAR
Café robusta	CAFRO
Azúcar sin refinar (<i>raw sugar</i>)	AZSRF
Azúcar refinada (<i>white sugar</i>)	AZREF
Otra materia prima distinta a las anteriores	OTROS

Registro 2: contempla información financiera general del contrato

	Campos
Fechas relevantes	Fecha de inicio
	Fecha de Fixing 1 para el índice de referencia por la compra de la materia prima.
	Fecha de Fixing 2 para el índice de referencia por la compra de la materia prima.
	Fecha de Fixing 1 para el índice de referencia por la venta de la materia prima.
	Fecha de Fixing 2 para el índice de referencia por la venta de la materia prima.
	Fecha de termino
	Fecha de pago de la operación
	Fecha de inicio de la Modificación



Estas fechas resultan útiles para contratos que definen el precio a pagar o recibir por la materia prima según una ventana de tiempo para el cálculo del precio.

Registro 2: contempla información financiera general del contrato

	Campos
Uso de opciones	Moneda de prima/pago inicial
	Monto prima/pago inicial recibida(o)
	Monto prima/pago inicial entregada(o)
	Objetivo de la operación
	Convenio Marco
	País Jurisdicción del Contrato
	Garantías
	Cláusula de Recouponing
	Cláusula de término anticipado
En caso de anticipo de contratos	Fecha efectiva de término o liquidación anticipada
	Compresión de cartera o <i>Recouponing</i>
	Número total de registros de pagos

Registro 3: contempla información financiera específicas del contrato

	Campos
Campos llave	RUT Participante (Contraparte 1)
	Identificador del Contrato
	Fecha y hora de suscripción del Contrato
	Identificador de Operaciones Estructuradas
	Opciones: Instrumento subyacente
	Volumen notional pactado
	Unidad de Medida del Volumen notional Pactado
Según código ISO 4217	Moneda del precio de la Materia Prima

Descripción	Código
Barril	BRRL
Galón Americano	GALA
Galón Inglés	GALI
Kilo	KILO
Libra	LIBR
Onza troy	ONZT
Toneladas métricas	TONM
Otra unidad de medida distinta a la anterior	OTRO

Registro 3: contempla información financiera específicas del contrato

	Campos
Características del precio de compra de la materia prima	Precio fijo a pagar por la compra de la materia prima
	Índice de referencia de compra de la materia prima
	Spread sobre índice de referencia por la compra de la materia prima
Características del precio de venta de la materia prima	Precio Fijo a Recibir por la Venta de la Materia Prima
	Índice de Referencia por la Venta de la Materia Prima
	Spread sobre el Índice de Referencia por la Venta de la Materia Prima
	Precio barrera de entrada (<i>Knock-in</i>)
	Precio barrera de salida (<i>Knock-out</i>)

Descripción	Código
<i>Euronext</i>	EUNXT
<i>Interncontinental Exchange</i>	ICEXG
<i>International Petroleum Exchange</i>	IPEXG
<i>London Metal Exchange</i>	LMEXG
<i>Marketwire</i>	MKTWR
<i>New York Board of Trade</i>	NYBOT
<i>New York Mercantile Exchange</i>	NYMEX
<i>OPIS</i>	OPIXS
Otro índice de referencia distinto a los anteriores	OTROS

Registro 5: contempla información relacionada a los pagos del periodo para cada contrato

	Campos
Campos llave	RUT Participante (Contraparte 1)
	Identificador del Contrato
	Fecha y hora de suscripción del Contrato
	Identificador de Operaciones Estructuradas
	Correlativo de registro de pago
	Pago recibido/entre gado (R/E)
	Fecha de pago
	Monto pago (recibido/entre gado)
	Tipo de pago efectuado
Según código ISO 4217	Moneda de pago

Registro 6 y 7: en estos registros se registra información acerca de las garantías asociadas a los contratos

Registro 6	
	Campos
Campos llave	RUT Participante (Contraparte 1)
	Identificador del Contrato
	Fecha y hora de suscripción del Contrato
	Identificador de Operaciones Estructuradas
	Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)
Según código ISO 4217	Moneda de valorización de la garantía
	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida/entregada
	Monto umbral (" <i>Threshold</i> ") recibido/entregado
	Valor garantía (recibida/entregada)

Registro 7	
	Campos
Campos llave	RUT Participante (Contraparte 1)
	Identificador del Contrato
	Fecha y hora de suscripción del Contrato
	Identificador de Operaciones Estructuradas
	Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)
	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida/entregada
	Tipo activo en garantía
	Porcentaje tipo de activo en garantía

Registro 8: información relacionada al valor de mercado de los contratos.

	Campos
Campos llave	RUT Participante (Contraparte 1)
	Identificador del Contrato
	Fecha y hora de suscripción del Contrato
	Identificador de Operaciones Estructuradas
	Método de valorización
Según código ISO 4217	Moneda de valorización
	Valor de mercado neto
	Valor de mercado activo
	Valor de mercado pasivo
Uso de opciones	Opciones: Volatilidad implícita
	Opciones: Delta
	Opciones: Gamma
	Opciones: Vega
Campos aplican solo para <u>bancos</u>	Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte
	Ajuste a la valorización por <i>BID-OFFER Spread</i>
	Otros ajustes a la valorización

Carga de información - independiente de la periodicidad del reporte, estos deben ser enviado mediante la plataforma destinada para esto: www.siid.bcentral.cl.

Posterior a la primera carga de información, **existen alternativas de autollenado** para facilitar la carga de información de reportes posteriores.

Sistema Integrado de Información de Derivados (SIID)

Usuario

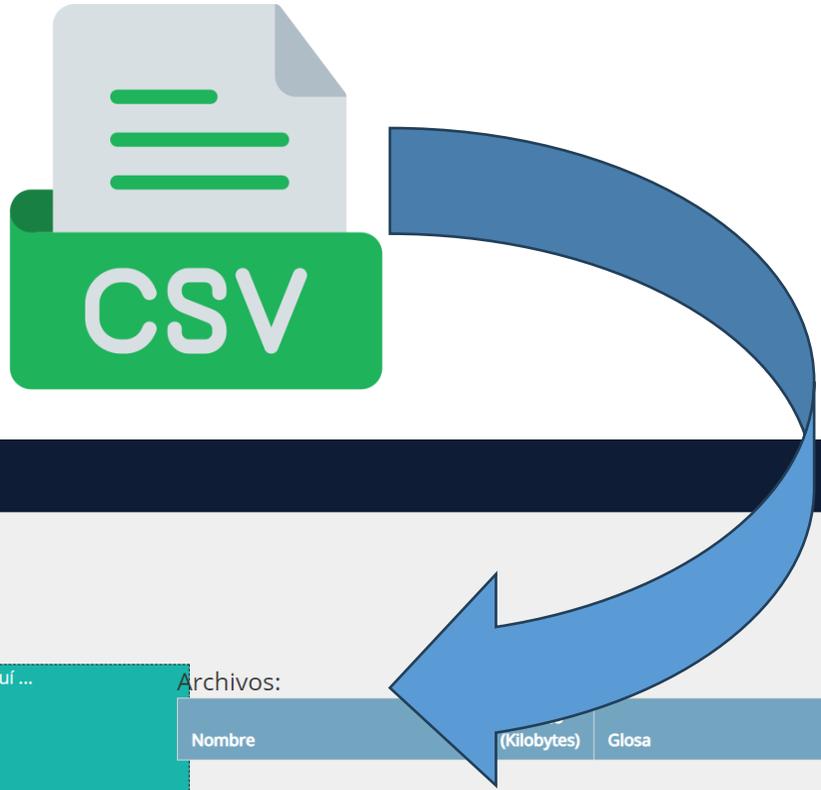
Contraseña

Token

[Olvidé mi contraseña](#)

Permanecer conectado?

Ingresar



banco central Chile

Ignacio Ben...

Archivos masivos

Arrastre sus archivos aquí ...

Archivos:

Nombre	(Kilobytes)	Glosa
--------	-------------	-------

Elegir archivo No se ha seleccionado ningún archivo

Formato del archivo –

Se detallan algunos formatos transversales a la estructura del archivo. Estos serán parte de las validaciones de estructura del archivo.

En las **Especificaciones Técnicas** se podrá ver el formato para cada uno de los campos. Estas especificaciones serán publicadas en mayo 2024.

Consideraciones	Formato	Ejemplo
Formato archivo	CSV (comma-separated values)	
Fecha	Date: yyyy-mm-dd	2020-11-05
Fecha Suscripción	Datetime: yyyy-mm-ddThh:mm:ss	2020-11-05T14:31:46
RUT	Varchar(9) sin puntos, con dígito verificador y sin guión	999999999
Montos	Num(15,5), corresponde a un máximo de 15 enteros y a un máximo de cinco decimales.	5000000.555
Separador de decimales	“ . ” (punto)	5000000.555
Separador de miles	Sin separador de miles.	5000000.555
Separador de campos	“ ; ” (punto y coma)	5000000.555;USD
Campos nulos o sin datos	Se muestran sin espacios.	;;
Alineamiento de los campos	Los campos se informan sin alinear, ya que están expresados con separadores de campo.	
Monedas	Norma ISO 4217, alpha -3. En el caso de la cotización <i>offshore</i> del Yuan considerar el código CNH.	CLP
Países	Norma ISO 3166-1, alpha -3	CHL
Fin de línea	Para finalizar el último valor de una línea de información, solo se informa el valor. No se debe agregar ningún carácter.	



Acreditación – las empresas que no estén reportando otros subyacentes al SIID, deberán realizar un proceso de acreditación donde definan a sus Administradores de perfiles.

Existen dos alternativas:

- Conservar los administradores de perfiles del CNCI
- Firmar los Anexos 1 y 1.2 del SIID por parte del Gerente General y Gerente Legal definiendo a los administradores de perfil

ANEXO N° 1.2
FORMULARIO DESIGNACIONES PARA PARTICIPANTES DEL SIID

Santiago, [] de [] de []

Señor
Ministro de Fe
Banco Central de Chile
Presente

De nuestra consideración:

Por medio de la presente, y en cumplimiento a lo establecido en el Reglamento Operativo del SIID, contenido en el Capítulo III.D.3.1 del Compendio de Normas Financieras, vengo en informar a usted la designación del (los) siguiente(s) Administrador (es) de Perfiles y/o de Agentes Autorizados para remitir información al Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (SIID) de nuestra empresa:

Nombre Administrador de Perfiles (*)	R.U.T	Cargo	Correo electrónico	Teléfono

(*) Solo podrán ser designados dos Administradores de Perfiles por Participante.

[En caso que declare sólo a través de las alternativas siguientes, se debe dejar en blanco el cuadro de Administradores de Perfiles]

[En caso que la entidad que suscribe la solicitud tenga la calidad de sociedad filial de una Empresa Bancaria, conforme al artículo 70 letra a) de la Ley General de Bancos:

Asimismo, informo a usted que el reporte de operaciones al SIID será realizado por la siguiente empresa bancaria matriz, quien actuará a través de sus propios Administradores de Perfiles:

Nombre o Razón Social Empresa Bancaria Matriz	R.U.T	Correo electrónico de contacto	Teléfono de contacto

[En caso que la entidad que suscribe la solicitud tenga la calidad persona relacionada, diversa de una Filial Bancaria, respecto de otro Participante del SIID:

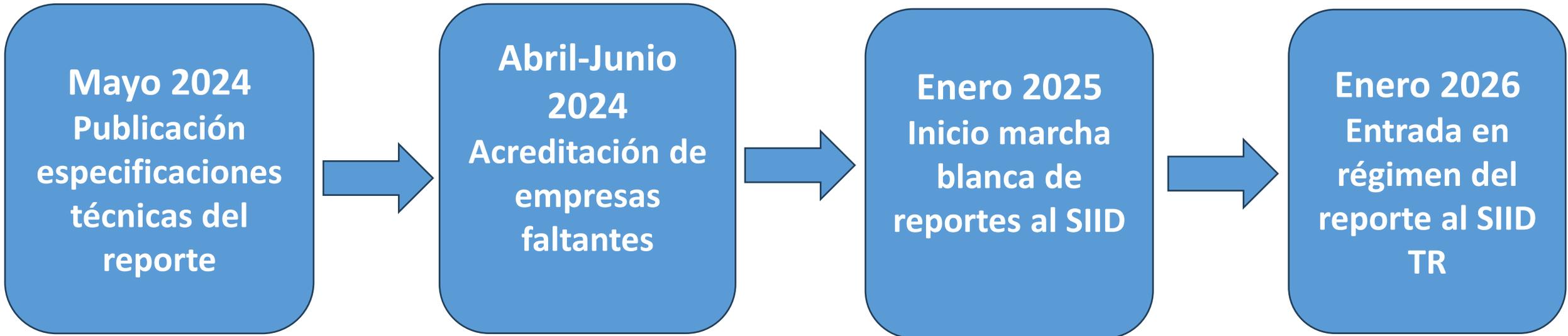
Asimismo, informo a usted que el reporte de operaciones al SIID será realizado por el siguiente Participante del SIID, quien actuará a través de sus propios Administradores de Perfiles:

Nombre o Razón Social Participante del SIID que remitirá la información en representación de la empresa	R.U.T	Correo electrónico de contacto	Teléfono de contacto

Circular N° 3013-862 – 13.10.2020



Fechas relevantes



Desarrollo tecnológico por parte de las empresas reportantes y reuniones con el Banco Central

Coordinación y consultas – dispondremos de distintos canales e instancias para que los reportantes puedan cumplir con el envío de la información

banco central Chile SIID-TR

Acerca del SIID - TR Normativa Monitor de derivados Estadísticas y Publicaciones Instrucciones de reporte Reportes al SIID

Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (SIID-TR) de Chile

Datos al: 20-03-2024

Bancos. Montos transados (M UF)		Bancos. Montos vigentes (M UF)	
Forward UF-CLP con el mercado local		Forward UF-CLP con el mercado local	
Compras	Ventas	Netos	
1,470	8	-417,747	

Bienvenidos al SIID-TR

El Banco Central de Chile, en ejercicio de sus competencias legales, incluyendo el ejercicio de su potestad normativa, ha emitido una regulación (Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras) y desarrollado el Sistema Integrado de Información sobre transacciones de Derivados ("SIID" o "SIID-TR") que opera como un repositorio de derivados siguiendo las mejores prácticas y recomendaciones internacionales para un TR, y por lo tanto adhiriendo a los PFMIs que le resulten aplicables.

A esta infraestructura de mercado deben reportar las personas residentes o domiciliados en Chile (Participantes del SIID), quienes corresponden a bancos, sus Filiales, y otras entidades fiscalizadas por la Comisión para el Mercado Financiero (CMF), así como todos aquellos que realicen transacciones de derivados con no residentes, sobre tipos de cambios, unidades de fomento, tasas de interés y renta fija, de acuerdo a las normas establecidas en el Capítulo III.D.1 del Compendio de Normas Financieras del

Novedades



Ver todas las noticias



siiderivados@bcentral.cl



Incorporación derivados sobre Materias Primas al SIID TR

SIID-TR

Sistema Integrado de Información
sobre Transacciones de Derivados