CARTA CIRCULAR

Bancos	N° 720
Filiales bancarias comprendidas en el art. 70 letra a) de la LGB	N° 14
Entidades MCF no bancarias	N° 24
Otras entidades fiscalizadas CMF	N° 15
Otros domiciliados o residentes	N° 15
Agentes Autorizados Cap. III.D.3 CNF	N° 13

ANT.:
1. Cartas Circulares del 12 de marzo de 2020, 29 de marzo de 2021, 24 de septiembre de 2021 y del 11 de agosto de 2023, que informan y actualizan las Especificaciones Técnicas y Tablas relativas al Reglamento Operativo del Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (RO-SIID).
2. Acuerdo N° 2236-01-190711, que aprobó el Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras "Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (SIID)" y su respectivo Reglamento Operativo.
3. Acuerdo N° 2416-01-210819, que modificó los Capítulos III.B.1 y III.D.1 del Compendio de Normas Financieras en materia de tasas de interés extranjeras de referencia.

MAT.: Nueva actualización de Especificaciones Técnicas y Tablas relativas al Reglamento Operativo del Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (RO-SIID).

Santiago, 6 de noviembre de 2023

Señor Gerente:

Adjunto a la presente, sírvase encontrar una actualización del documento Especificaciones Técnicas y Tablas relativas al Reglamento Operativo del Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (RO-SIID), el que define y explica la estructura de los archivos para los diferentes Sistemas de Información del SIID y proporciona las tablas de códigos que deben considerarse para la elaboración de estos por parte de los Participantes, para dar cumplimiento a lo establecido en el Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras y su RO-SIID. La actualización del citado documento se adopta en ejercicio de las facultades conferidas por el Título IV del citado Capítulo III.D.3.

La nueva versión del documento incorpora las modificaciones al Reglamento Operativo del SIID detalladas en la Circular 3013-933 del 30 de octubre 2023, considerando el período de marcha blanca establecido.

Saluda atentamente a usted,

CARMEN GLORIA ESCOBAR J.
Gerente de Información Estadística

Especificaciones Técnicas y Tablas relativas al Reglamento Operativo del Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (RO-SIID)

REGISTRO DE VERSIONES

Nº VERSIÓN	FECHA	COMENTARIOS
Versión 1.0	12-03-2020	
Versión 1.1	29-03-2021	Se realizan precisiones en algunos campos. Se especifica el reporte de información por parte de las Administradoras Generales de Fondos y Fondos de Pensiones.
Versión 1.2	20-09-2021	Se actualiza Tabla 9 Tipo de Tasa de Interés, Tabla 12 Garantías y Tabla 16 Tipo de Activo en Garantía y se actualizan anexos 2ª, 2B y 2C.
Versión 1.3	11-08-2023	Se incorporan los Anexos 3 y 4, y se actualiza Tabla 2 - Eventos de Reporte, Tabla N° 9 - Tipo de Tasa de Interés y Tabla N° 12 – Garantías.
Versión 1.4	6-11-2023	Se actualiza documento conforme a la modificación del RO-SIID, Circular 3013-933.

Contenido

I. INTRODUCCIÓN 5
II. FORMATO, NOMBRE DE ARCHIVOS Y *HEADER* 5
III. TIPO DE REGISTRO DE LOS ARCHIVOS 5
IV. FORMATOS MÁS IMPORTANTES 7
V. TABLAS Y CÓDIGOS 7
VI. FORMATO DE CAMPOS, SEGÚN SISTEMA O ACTIVO SUBYACENTE 7
VII. EJEMPLO ARCHIVO REPORTE DIARIO- CSV 7
VIII. ESTRUCTURA DE LOS ARCHIVOS REPORTADOS POR ADMINISTRADORAS DE FONDOS DE PENSIONES (AFPs), ADMINSITRADORAS GENERALES DE FONDOS (AGFs) Y REPORTANTES INDIRECTOS QUE INFORMAN A NOMBRE DE OTRA ENTIDAD. 11
ANEXOS 12
ANEXO 1: DETALLE DE TABLAS Y CÓDIGOS DEL SIID-TR 12
Tabla 1: Naturaleza de la Información 13
Tabla 2: Eventos de Reporte 13
Tabla 3: Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente 13
Tabla 4: Instrumentos 13
Tabla 5: Clase de Opción 14
Tabla 6: Tipo de Posición 14
Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente 14
Tabla 8: Modalidad de Liquidación 14
Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés 15
Tabla 10: Objetivo de la Operación 17
Tabla 11: Convenio Marco 17
Tabla 12: Garantías 18
Tabla 13: Cláusula de *Recouponing* 19
Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado 19
Tabla 15: Compresión de Cartera 19
Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía 19
Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado 20
Tabla 18: Método de Valorización 20
ANEXO 2.A: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE MONEDAS 21
ANEXO 2.B: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE TASAS DE INTERÉS 42
ANEXO 2.C: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA 63
ANEXO 3: INSTRUCTIVO PARA MODIFICACIÓN DE REPORTES MENSUALES 77
ANEXO 4: INSTRUCTIVO PARA LA CARGA DE INFORMACIÓN MENSUAL MEDIANTE LA FUNCIONALIDAD DE AUTOCOMPLETADO DE CAMPOS 80

I. INTRODUCCIÓN

Este documento está dirigido a los distintos Participantes o agentes de mercado que, según el Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras, están obligados a reportar al Banco Central de Chile sus contratos de instrumentos derivados sobre monedas o tipos de cambios (incluyendo los CLP/UF), tasas de interés e instrumentos de renta fija. Estos Participantes son Bancos y sus filiales, Fondos de Pensiones, empresas del Sector Real, Corredoras de Bolsa, Agencias de Valores, Administradoras Generales de Fondos (AGFs), Compañías de Seguros, y cualquier otro intermediario financiero regulado por la Comisión para el Mercado Financiero (CMF), de acuerdo con lo indicado en el citado Capítulo III.D.3. Adicionalmente, considera a residentes que efectúen transacciones de derivados con el exterior.

II. FORMATO, NOMBRE DE ARCHIVOS Y *HEADER*

Formato y Nombre: Se solicita que los archivos sean enviados en formato CSV (*comma-separated values*). Respecto del nombre del archivo, no existen restricciones.

Cada archivo debe contener en la primera línea un *header*, de acuerdo con las siguientes especificaciones:

***Header*:** largo 20 caracteres, con la estructura:

XXXXXXXXXCCCAAAAMMDD

Donde:

XXXXXXXXX	Corresponde al RUT de la institución reportante en el SIID (sin guion y con dígito verificador).
CCC	Código del reporte según Tabla 1.
AAAAMMDD	Fecha del reporte a la que se refieren los datos del archivo, indicando año, mes y día.

Tabla 1. Códigos, según tipo de reporte y subyacente

Código	Archivo o reporte
DFX	Diario sobre monedas
MFX	Mensual sobre monedas
DIR	Diario sobre tasas de interés
MIR	Mensual sobre tasas de interés
DFI	Diario sobre instrumentos de renta fija
MFI	Mensual sobre instrumentos de renta fija
CFX	Corrección mensual sobre monedas
CIR	Corrección mensual sobre tasas de interés
CFI	Corrección mensual sobre renta fija

III. TIPO DE REGISTRO DE LOS ARCHIVOS

Luego del *header,* el archivo continúa con los registros sobre los contratos a reportar, los cuales se encuentran separados en ocho secciones detalladas en la Tabla 2. Para flexibilizar el reporte, no existe un requerimiento específico respecto del orden de recepción de las secciones de los archivos. Sin embargo, es necesario que cada línea inicie con los campos llaves (*Primary Key*), seguido de los campos de cada sección del archivo. Se debe considerar que, para las secciones sobre pagos y activos de garantías, podrá haber tantas líneas como tipos de pagos o activos de garantía, respectivamente, tenga el contrato reportado.

En el caso de los reportes diarios, la información solicitada por el RO-SIID, para todos sus sistemas (monedas, tasas de interés e instrumentos de renta fija) en las Secciones 1 sobre "Condiciones Financieras de la Operación", según los numerales 1.A –Información General– y 1.B –Calendario de Flujos–, se han contenido en cuatro tipos de registros a identificar en los archivos CSV. Estos se encuentran consignados en la Tabla 3.

Por su parte, la información adicional requerida por el RO-SIID para los reportes mensuales, dispuesta en la Sección 2 sobre “Pagos del periodo”, Sección 3 relativa a “Garantías” y Sección 4 sobre “Valor de Mercado”; son contenidas en cuatro tipos de registros, según la Tabla 3.

Así, en la Tabla 3 se especifican los tipos de registros que deben ser reportados en los archivos diarios y mensuales.

Tabla 2. Resumen de secciones de archivos

Tipo de registro	**Descripción**
01	Identificación del Contrato
02	Condiciones financieras generales del contrato
03	Condiciones financieras específicas del contrato
04	Calendario de flujos
05	Pagos
06	Garantías
07	Detalle tipo activo en garantía
08	Valorización a precios de mercado

Tabla 3. Resumen de secciones a enviar, según sistema y periodicidad de reporte

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

Donde:
FX: Requerimiento del Sistema de monedas.
IR: Requerimiento del Sistema de tasas de interés.
FI: Requerimiento del Sistema de instrumentos de renta fija.

Junto a este documento, se entrega una descripción de cada uno de los campos que componen a cada tipo de sistema o subyacente (monedas, tasas de interés e instrumentos de renta fija), así como sus respectivos formatos. Lo anterior, según lo indicado en el RO-SIID (Capítulo III.D.3.1).

IV. FORMATOS MÁS IMPORTANTES

Si bien en el Anexo 2 se detalla el formato de cada uno de los campos, a continuación, se presenta un resumen de los formatos de los campos más usados:

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-
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
Tasas /Spread	Num(4,10), corresponde a un máximo de 4 enteros y a un máximo de 10 decimales.	2.75
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.	
Tipo de registro	Char(2) Orden de las secciones. Se recomienda que se informen en forma ascendente, pero se procesarán independientemente del orden.	01
Monedas	Norma ISO 4217, alpha -3. En el caso de la cotización *offshore* del Yuan considerar el código CNH.	CLP
Países	Norma ISO 3166-1, alpha -3	CHL
Plataforma de negociación	MIC "*Market Identifier Code*" Norma ISO 10383, alpha-4	XBCL
Convenio marco	Char(25) según Tabla 11 Convenio Marco + número convenio.	ISDA987654321
Fin de línea	Para finalizar el último valor de una línea de información, solo se informa el valor. No se debe agregar ningún carácter.	

V. TABLAS Y CÓDIGOS

Para la elaboración de los archivos se deberá considerar el listado de tablas y códigos definidos en el Anexo 1, para cada uno de los Sistemas de Información o activo subyacente.

VI. FORMATO DE CAMPOS, SEGÚN SISTEMA O ACTIVO SUBYACENTE

En los anexos 2.A, 2.B y 2.C, se detalla el formato de cada uno de los campos relevantes para cada uno de los Sistemas del SIID, junto con un ejemplo de dato.

VII. EJEMPLO ARCHIVO REPORTE DIARIO- CSV

A continuación, se presenta un ejemplo de archivo CSV para un contrato que se debe informar en forma diaria, según el sistema de Monedas (FX).

Ejemplo: Se considera el siguiente contrato (datos ficticios y solo para fines referenciales):

Información del contrato:

RUT contraparte 1	12345678-5
Tipo de envío	Diario
Fecha de envío	2021-01-15
Identificador del contrato	98765
Fecha de suscripción	2021-01-12 a las 14:31:46
Id. operación estructurada	0
Naturaleza de la información	Y
Evento de reporte	NUE
LEI contraparte 1	213800PM785MT657TJ13
RUT contraparte 2	98765432-5
LEI contraparte 2	213800FQ9YXIEP9GZG11
Nombre o razón social contraparte 2	ABCD
País contraparte 2	CHL
RUT de entidad de contraparte central	76317889-7
LEI de entidad de contraparte central	213800FQ9YXIEP9GZG11
RUT participante directo/agente liquidador de la entidad de contraparte central de la contraparte 1	76317889-7
LEI participante directo/agente liquidador de la entidad de contraparte central de la contraparte 1	213800FQ9YXIEP9GZG11
RUT agente de cálculo	76317889-7
LEI agente de cálculo	213800FQ9YXIEP9GZG11
Nombre o razón social agente de cálculo	ABCD
RUT del cedente o cesionario	No aplica
LEI cedente o cesionario	No aplica
Plataforma de negociación	XBCL
RUT intermediario	111111111
LEI intermediario	9695005RU7JILXCDUF47
Instrumento	CCS
Identificador del contrato para agente autorizado	No aplica
Opciones-Clase	No aplica
Opciones: Posición en la operación	No aplica
Modalidad de liquidación	CO
Moneda de compensación	USD
Fecha de inicio	2021-01-18
Fecha fixing 1	2025-01-17
Fecha de término	2025-01-20
Fecha de pago de la operación	2025-01-20
Fecha de inicio de la modificación	No aplica
Moneda de prima/pago inicial	No aplica
Monto prima/pago inicial recibida(o)	No aplica
Monto prima/pago inicial entregada(o)	No aplica
Objetivo de la operación	CFC
Convenio marco	CCGG123456
País jurisdicción del contrato	CHL
Garantías	CC
Cláusula de recouponing	N
Cláusula de término anticipado	NOT
Fecha efectiva de término o liquidación anticipada	No aplica
Compresión de cartera	N
Número total de intercambios o flujos	4
Número total de registros de pagos	No aplica
Opciones: Instrumento subyacente	No aplica
Moneda comprada	USD

Monto moneda comprada	1000000
Moneda vendida	CLP
Monto moneda vendida	750000000
Tipo de tasa de interés a recibir	US0012M
Tipo de tasa de interés a entregar	TABU12M
Fecha *fixing* 2	No aplica
Convención tipo de cambio	USD/CLP
Precio pactado a futuro (tipo cambio futuro)	750
Puntos forward	-5
Precio barrera de entrada (*Knock-in*)	No aplica
Precio barrera de salida (*Knock-out*)	No aplica
Número total del flujo	2

Calendario

Número del fluio	1
Tipo de fluio	R
Factor sobre tasa de interés variable	No Aplica
Spread sobre tasa de interés variable:	0.02
Tasa de interés fija	No aplica
Fecha de *fixing* para tasa de interés	2022-01-14
Fecha de inicio del fluio	2021-01-18
Fecha de término del fluio	2022-01-17
Monto nocional aplicable al fluio	1000000
Monto fluio como intercambio del capital	500000
Moneda del monto como intercambio de capital	USD
Número del fluio	1
Tipo de fluio	E
Factor sobre tasa de interés variable	No Aplica
Spread sobre tasa de interés variable:	0.05
Tasa de interés fija	No aplica
Fecha de *fixing* para tasa de interés	2022-01-14
Fecha de inicio del fluio	2021-01-18
Fecha de término del fluio	2022-01-17
Monto nocional aplicable al fluio	750000000
Monto fluio como intercambio del capital	375000000
Moneda del monto como intercambio de capital	CLP
Número del fluio	2
Tipo de fluio	R
Factor sobre tasa de interés variable	No Aplica
Spread sobre tasa de interés variable:	0.02
Tasa de interés fija	No aplica
Fecha de *fixing* para tasa de interés	2023-01-13
Fecha de inicio del fluio	2022-01-17
Fecha de término del fluio	2023-01-16
Monto nocional aplicable al fluio	500000
Monto fluio como intercambio del capital	500000
Moneda del monto como intercambio de capital	USD
Número del fluio	2
Tipo de fluio	E
Factor sobre tasa de interés variable	No Aplica
Spread sobre tasa de interés variable:	0.05
Tasa de interés fija	No aplica
Fecha de *fixing* para tasa de interés	2023-01-13
Fecha de inicio del fluio	2022-01-17
Fecha de término del fluio	2023-01-16
Monto nocional aplicable al fluio	375000000
Monto fluio como intercambio del capital	375000000
Moneda del monto como intercambio de capital	CLP

Ejemplo del contenido del archivo diario CSV del contrato anterior:

123456785DFX20210115
1;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;Y;NUE;213800PM785MT657TJ13;987654325;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;CHL;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;;;XBCL;111111111;9695005RU7JILXCDUF47
2;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;CCS;;;;CO;USD;2021-01-18;2023-01-13;2023-01-16;2023-01-16;;;;;CFC;CCGG123456;CHL;CC;N;NOT;;N;2;
3;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;;USD;1000000;CLP;750000000;US0012M;TABU12M;;USD/CLP;750;-5;;
4;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;1;R;;0.02;;2022-01-14;2021-01-18;2022-01-17;1000000;500000;USD
4;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;1;E;;0.05;;2022-01-14;2021-01-18;2022-01-17;750000000;375000000;CLP
4;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;2;R;;0.02;;2023-01-13;2022-01-17;2023-01-16;500000;500000;USD
4;123456785;98765;2021-01-12T14:31:46;0;2;E;;0.05;;2023-01-13;2022-01-17;2023-01-16;375000000;375000000;CLP

VIII. ESTRUCTURA DE LOS ARCHIVOS REPORTADOS POR ADMINISTRADORAS DE FONDOS DE PENSIONES (AFPs), ADMINSITRADORAS GENERALES DE FONDOS (AGFs) Y REPORTANTES INDIRECTOS QUE INFORMAN A NOMBRE DE OTRA ENTIDAD.

Las Administradoras de Fondos de Pensiones (AFP) y las Administradoras Generales de Fondos (AGF) deben reportar a nombre de cada uno de sus fondos. Para esto, la cabecera (*header*) del archivo debe contener el RUT de la entidad que está enviando el reporte de información. Mientras que los campos asociados a la identificación de la Contraparte 1, se deberán llenar de acuerdo con la siguiente tabla:

Institución Reportante	RUT *Header*	RUT Contraparte 1	Razón Social Contraparte 1	LEI Contraparte 1
AFP	Rut AFP	Rut AFP	Razón social de la AFP	Código LEI del Fondo de la AFP. (Ejemplo: Código LEI del Fondo A de una AFP)
AGF	Rut AGF	Rut del fondo administrado por la AGF	Razón social del fondo administrado por la AGF	Código LEI del Fondo administrado por la AGF, en caso de que el fondo disponga de uno, en el caso contrario, el código de LEI de la AGF, de contar con uno.

En el caso de que una AGF o AFP decida que su información sea enviada a través de un Reportante Indirecto o Agente Autorizado, la cabecera (*header*) del archivo deberá llevar el RUT del Reportante Indirecto o Agente Autorizado, mientras que los datos referentes a la Contraparte 1, se completarán según la señalado en la tabla anterior.

Por ejemplo, para una AGF de RUT 60.000.000-4, que administra tres fondos, con los RUTS: 61.000.000-2, 62.000.000-0 y 63.000.000-9, un ejemplo de archivo mensual es el siguiente:

600000004MFX20201130
1;610000002;Id_000126798;2020-10-01T10:35:47;0;Y;MVI;;500000007;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;CHL;;;;;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;Agente de cálculo;;;OTC;;
1;620000000;Id_000126472;2020-10-02T09:15:04;0;Y;MVI;;500000007;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;CHL;;;;;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;Agente de cálculo;;;OTC;;
1;630000009;Id_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;Y;MVI;;500000007;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;CHL;;;;;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;Agente de cálculo;;;OTC;;
2;610000002;Id_000126798;2020-10-01T10:35:47;0;FWD;;;;CO;USD;2020-10-02;2021-01-12;2021-01-13;2021-01-14;;;;;CFC;isda12345;CHL;SC;N;NOT;;N;1;0
2;620000000;Id_000126472;2020-10-02T09:15:04;0;FWD;;;;CO;USD;2020-10-03;2021-01-13;2021-01-14;2021-01-14;;;;;CFC;isda6789;CHL;SC;N;NOT;;N;1;0
2;630000009;Id_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;FWD;;;;CO;USD;2020-10-06;2021-01-13;2021-01-14;2021-01-14;;;;;CFC;isda9876;CHL;SA;N;NOT;;N;1;0
3;610000002;Id_000126798;2020-10-01T10:35:47;0;;USD;2000000;CLP;1516000000;;;;USD/CLP;758;-1.57;;
3;620000000;Id_000126472;2020-10-02T09:15:04;0;;USD;1000000;CLP;747320000;;;;USD/CLP;747.32;3.67;;
3;630000009;Id_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;;USD;4000000;CLP;2930680000;;;;USD/CLP;732.67;3.67;;
6;630000009;Id_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;E;CLP;Portafolio_Id_1234;500000;467903.274
7;630000009;Id_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;E;Portafolio_Id_1234;BBCH;55
7;630000009;Id_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;E;Portafolio_Id_1234;BTGR;45
8;610000002;Id_000126798;2020-10-01T10:35:47;0;M;USD;147984.2365;;;;;24560;;5650
8;620000000;Id_000126472;2020-10-02T09:15:04;0;M;USD;67894.382;;;;;24560;;5650
8;630000009;Id_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;M;USD;-672830.451;;;;;24560;;5650

ANEXOS

ANEXO 1: DETALLE DE TABLAS Y CÓDIGOS DEL SIID-TR

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 Recouponing
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

Tabla 1: Naturaleza de la Información

Descripción	Código
El Evento de Reporte se comunica en cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos I y IX del CNCI, sobre operaciones con instrumentos derivados, o en la normativa cambiaria sobre operaciones con instrumentos derivados que en el futuro pueda modificar o sustituir dicha regulación, incluyendo a este respecto los requerimientos de información cambiaria que contenga el Capítulo III.D.3 del CNF.	Y
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.	N

Tabla 2: Eventos de Reporte

Numeral del tipo de evento	Tipo de reporte	Descripción	Código
2.1.1	Diario	Nuevo contrato	NUE
2.1.2	Diario	Adquisición por cesión	ACS
2.2.1	Diario	Modificación por *recouponing*	MRC
2.2.2	Diario	Modificación de contraparte por cesión	MCS
2.2.3	Diario	Otras modificaciones	OMD
2.2.4	Diario	Modificación por corrección de reporte	MCR
2.3.1	Diario	Término por caducidad, anticipo o resciliación	AOC
2.3.2	Diario	Término por cesión	CES
2.3.3	Diario	Término por anulación	ANU
2.3.4	Mensual	Mensual operaciones vencidas	MVE
2.2.4	Mensual	Mensual anulación de operaciones informadas	REL
2.2.4	Mensual	Mensual rectificación de operaciones vencidas	RVE
2.4.1	Mensual	Mensual operaciones vigentes	MVI
2.2.4	Mensual	Mensual rectificación de operaciones vigentes	RVI
2.2.4	Mensual	Mensual incorporación operaciones no informadas	RNU

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

Descripción	Código
International Securities Identification Number (ISIN)	ISI
Nemotécnico	NEM
Alternative Instrument Identifier (AII)	AII
Committee on Uniform Securities Identification (CUSIP)	CUS
Stock Exchange Daily Official List (SEDOL)	SED
Otro Identificador distinto de los anteriores	OTR

Tabla 4: Instrumentos

Descripción	Subsistema al que aplica	Código
Cross Currency Swap	I (Monedas)	CCS
Forward Observado	I (Monedas)	FOB

FX Swap	I (Monedas)	FXS
Futuro	I, II y III (Monedas, Tasas de Interés y Renta fija, respectivamente)	FUT
Forward	I, II y III (Monedas, Tasas de Interés y Renta fija, respectivamente)	FW D
Swaption	I y II (Monedas y Tasas de Interés, respectivamente)	STN
Opción *Call*	I (Monedas)	CAL
Opción *Put*	I (Monedas)	PUT
Opción *Cap*	II y III (Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente)	CAP
Opción *Floor*	II y III (Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente)	FLR
Interest Rate Swap	II (Tasa de Interés)	SW P
Otro distinto de los anteriores	I, II y III (Monedas, Tasas de Interés y Renta fija, respectivamente)	OTR

Tabla 5: Clase de Opción

Descripción	Código
Americana	AM
Bermuda	BE
Europea	EU
Asiática	AS
Otra clase distinta de las anteriores	OT

Tabla 6: Tipo de Posición

Descripción	Código
Compradora	BYE
Vendedora	SLL

Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente

Descripción	Sistema al que aplica	Código
Cross Currency Swap	I (Monedas)	CCS
Interest Rate Swap	II (Tasas de Interés)	SW P

Tabla 8: Modalidad de Liquidación

Descripción	Código
Compensación	CO
Entrega Física	EF

Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés

Descripción	Código
Tasa fija	FIXEDRT
Australia	
AONIA (AUD Overnight Index Average)	RBACOR
BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a un día	BBSW1D
BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 30 días	BBSW1M
BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 60 días	BBSW2M
BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 90 días	BBSW3M
BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 120 días	BBSW4M
BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 150 días	BBSW5M
BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 180 días	BBSW6M
BBSW (Bank Bill Swap rate – Australia) a 360 días	BBSW1Y
Colombia	
Colombia Overnight Interbank Rate	COIBRON
Colombia Overnight Interbank Rate a 30 días	COIBR1M
Colombia Overnight Interbank Rate a 90 días Colombia Overnight Interbank Rate a 30 días	COIBR3M
Colombia Overnight Interbank Rate a 180 días	COIBR6M
Colombia Overnight Interbank Rate a 360 días	COIBR1Y
Brasil	
Brazil Interbank Deposit Certificate (CDI)	BRASCDI
Chile	
TNA o Tasa nominal anual (Índice Cámara Promedio – ABIF/GRSS–)	TNAICP0
TRA o Tasa real anual (Índice Cámara Promedio Real – ABIF/GRSS–)	TRAICP0
TAB en UF a 90 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo reajustables en UF –ABIF/GRSS–)	TABUF3M
TAB en UF a 180 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo reajustables en UF a 180 días –ABIF/GRSS–)	TABUF6M
TAB en UF a 360 días (Tasa de interés promedio ponderada de captaciones reajustables en UF a 360 días –ABIF/GRSS–)	TABU12M
TAB nominal a 30 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en pesos chilenos. – ABIF/GRSS–)	TABN01M
TAB nominal a 90 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en pesos chilenos – ABIF/GRSS–)	TABN03M
TAB nominal a 180 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en pesos chilenos – ABIF/GRSS–)	TABN06M
TAB nominal a 360 días (Tasa de interés promedio ponderada de captaciones en pesos chilenos a 360 días. –ABIF/GRSS–)	TABN12M
TADO a 30 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO01M
TADO a 60 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO02M
TADO a 90 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO03M
TADO a 180 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO06M
TADO a 360 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–)	TADO12M

Descripción	Código
Estados Unidos de América	
Prime Rate	PRIMERT
LIBOR en Dólares de los EE.UU. *overnight* (ICE)	US000ON
LIBOR en Dólares de los EE.UU. a 30 días (ICE)	US0001M
LIBOR en Dólares de los EE.UU. a 7 días (ICE)	US0001W
LIBOR en Dólares de los EE.UU. a 60 días (ICE)	US0002M
LIBOR en Dólares de los EE.UU. a 90 días (ICE)	US0003M
LIBOR en Dólares de los EE.UU. a 180 días (ICE)	US0006M
LIBOR en Dólares de los EE.UU. a 360 días (ICE)	US0012M
SOFR (*Secured Overnight Financing Rate*)	SOFRATE
Term SOFR a 30 días	SOFR01M
Term SOFR a 90 días	SOFR03M
Term SOFR a 180 días	SOFR06M
Term SOFR a 360 días	SOFR12M
EFFR (*Federal Funds Effective Rate)*	FEDFUND
OBFR (United States Overnight Bank Funding Rate)	USOBFRT
Tasa de la curva de rendimiento del Tesoro de los EE.UU. a 10 años	USTN10Y
Tasa de la curva de rendimiento del Tesoro de los EE.UU. a 3 años	USTN03Y
Euro	
LIBOR en Euros overnight (ICE)	EE000ON
LIBOR en Euros a 7 días (ICE)	EE0001W
LIBOR en Euros a 30 días (ICE)	EE0001M
LIBOR en Euros a 60 días (ICE)	EE0002M
LIBOR en Euros a 90 días (ICE)	EE0003M
LIBOR en Euros a 180 días (ICE)	EE0006M
LIBOR en Euros a 360 días (ICE)	EE0012M
€STER (*Euro Short-Term Rate*)	ESTERON
Euribor a 1 semana	EUR001W
Euribor a 2 semanas	EUR002W
Euribor a 30 días	EUR001M
Euribor a 60 días	EUR002M
Euribor a 90 días	EUR003M
Euribor a 180 días	EUR006M
Euribor a 270 días	EUR009M
Euribor a 12 meses	EUR012M
EONIA (*Euro Overnight Index Average*)	EONIAON
Inglaterra	
LIBOR en Libras esterlinas *overnight* (ICE)	BP000ON
LIBOR en Libras esterlinas a 7 días (ICE)	BP0001W
LIBOR en Libras esterlinas a 30 días (ICE)	BP0001M
LIBOR en Libras esterlinas a 60 días (ICE)	BP0002M
LIBOR en Libras esterlinas a 90 días (ICE)	BP0003M
LIBOR en Libras esterlinas a 180 días (ICE)	BP0006M
LIBOR en Libras esterlinas a 360 días (ICE)	BP0012M
SONIA (*Sterling Overnight Interbank Average Rate*)	SONIAON
México	
Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio a 1 día	TIIE0ON
Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio a 28 días Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio a 28 días	TIIE028
Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio a 91 días	TIIE091
Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio a 182 días	TIIE182

Descripción	Código
Suiza	
LIBOR en Francos suizos spot next day (ICE)	SF000ON
LIBOR en Francos suizos a 7 días (ICE)	SF0001W
LIBOR en Francos suizos a 30 días (ICE)	SF0001M
LIBOR en Francos suizos a 60 días (ICE)	SF0002M
LIBOR en Francos suizos a 90 días (ICE)	SF0003M
LIBOR en Francos suizos a 180 días (ICE)	SF0006M
LIBOR en Francos suizos a 360 días (ICE)	SF0012M
SARON (*Swiss Average Rate Overnight*)	SWAVRON
Japón	
Libor en Yenes japoneses spot *next day* (ICE)	JY000ON
Libor en Yenes japoneses a 7 días (ICE)	JY0001W
Libor en Yenes japoneses a 30 días (ICE)	JY0001M
Libor en Yenes japoneses a 60 días (ICE)	JY0002M
Libor en Yenes japoneses a 90 días (ICE)	JY0003M
Libor en Yenes japoneses a 180 días (ICE)	JY0006M
Libor en Yenes japoneses a 360 días (ICE)	JY0012M
TONA (*Tokyo Overnight Average Rate*)	TKAVRON
Otra tasa distinta de las anteriores	OTHERRT

Tabla 10: Objetivo de la Operación

Descripción	Código
Negociación	NEG
Cobertura de Riesgo de Posiciones del Balance	CPB
Cobertura Contable Valor Razonable	CVR
Cobertura Contable Flujo de Caja	CFC
Cobertura Contable de Inversiones Netas en el Exterior	CIE

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	Código*
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.	CCGG + número de contrato marco.
International Swaps and Derivatives Association.	ISDA + número de contrato marco
Otros convenios no contemplados previamente.	OTRO + número de contrato marco
No está sujeto a convenio marco.	NOSU

*: Este campo permite un máximo de 25 caracteres. De los cuales los primeros cuatro corresponden al convenio marco definido en la Tabla Convenio Marco y los restantes deben ser utilizados para indicar el número o código único asignado al convenio marco de contratación de derivados, según corresponda.

Tabla 12: Garantías

Descripción	Código
Completamente caucionado o garantizado: Ambos constituyen Margen Inicial y Margen de Variación	CG
Ambas partes constituyen alguna forma de garantía (Margen Inicial o Margen de Variación)	PG
Solo la Contraparte 1 constituye alguna forma de garantía (Margen Inicial y/o Margen de Variación)	SA
Solo la Contraparte 2 constituye alguna forma de garantía (Margen Inicial y/o Margen de Variación)	SB
La contraparte 1 proporciona otras formas de garantías	OA
La contraparte 2 proporciona otras formas de garantías	OB
Ninguna contraparte constituye garantías	SC
Contraparte Central	CC

Tabla 13: Cláusula de *Recouponing*

Descripción	Código
Con cláusula de *Recouponing*	Y
Sin cláusula de *Recouponing*	N

Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado

Descripción	Código
A favor de la Contraparte 1, con liquidación	CO1
A favor de la Contraparte 1, sin liquidación	C1S
A favor de la Contraparte 2, con liquidación	CO2
A favor de la Contraparte 2, sin liquidación	C2S
Opcional ambas partes, con liquidación	AMP
Opcional ambas partes, sin liquidación	AMS
Sin cláusula de término anticipado	NOT

Tabla 15: Compresión de Cartera o *Recouponing*

Descripción	Código
Contrato es resultado de una compresión de cartera o un Recouponing	Y
Contrato no es resultado de una compresión de cartera o un Recouponing	N

Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía

Descripción	Código
Efectivo	CASH
Depósitos	DEPO
Bonos Corporativos	BCOR
Bonos del Banco Central de Chile	BBCH
Bonos de la Tesorería General de la República de Chile	BTGR
Bonos Soberanos Extranjeros	BSEX
Bonos Corporativos Extranjeros	BCOX
Acciones	ACCS
Fondos Mutuos nacionales tipo 1* y Fondos del Mercado Monetario o Money Market Funds** internacionales	FMM M
Otros Fondos Mutuos	FOTR
Bienes Inmuebles	BSIM
Otros activos en garantías distinto de las anteriores	OTRO

*Según lo dispuesto en la Circular N°1.578 de 2002 emitida por la Comisión para el Mercado Financiero, la cual establece la clasificación de Fondos Mutuos según su política de inversiones.
** Corresponden a Fondos del Mercado Monetario o Money Market Funds, aquellos fondos que son reconocidos como tales, según los reglamentos y normas emitidos por la autoridad competente del respectivo país de emisión del fondo.

Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado

Pago o intercambio de intereses (aplica para entrega física y compensación)	I
Pago o intercambio de principales (aplica para entrega física y compensación)	C
Prima o pago realizado al inicio del contrato	P
Pago originado por el cierre anticipado del contrato	A
Pago originado por *recouponing*	R
Otro tipo de pago distinto de los anteriores	O

Tabla 18: Método de Valorización

Descripción	**Código**
Valor razonable a precios de mercado (*mark-to-market*)	M
Valor razonable utilizando modelos (*mark-to-model*)	O
Valor razonable calculado por Contraparte Central	C
Otro método de valorización distinto de los anteriores	T

ANEXO 2.A: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE MONEDAS

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
1.A. Información general							
	01				**Tipo de registro**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	33	Fecha y hora de suscripción del contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			1	Naturaleza de la información	Debe precisarse si los antecedentes que conforman el respectivo Evento de Reporte se entregan o no al BCCh en cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos I y IX del CNCI, o en la normativa cambiaria sobre operaciones con instrumentos derivados, que en el futuro pueda modificar o sustituir dicha regulación, según Tabla Naturaleza de la Operación.	Char(1)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			2	Evento de Reporte	Código que identifica el tipo de registro que será informado o reportado, según la Tabla Eventos de Reporte. Este podrá corresponder a: **2.1 Suscripción** 2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante. 2.1.2 Adquisición por cesión: Cuando el Participante asume las obligaciones y es cesionario de los derechos vinculados a un Contrato suscrito anteriormente por un tercero. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la celebración de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar un evento de suscripción para cada instrumento comprendido en la estructura. **2.2 Modificación** Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante. 2.2.1 Recouponing: Modificación de las condiciones financieras de un Contrato a consecuencia de pagos que hacen las partes con el objeto de modificar su valor razonable (mark to market). 2.2.2 Modificación de contraparte por cesión: El Participante que permanece en el Contrato cedido debe informar que su contraparte ha cambiado producto de una cesión. No procederá informar como cesión la novación de las obligaciones de un Contrato producto de la compensación y liquidación de las mismas en una entidad de Entidad de Contraparte Central. 2.2.3 Otras modificaciones: Cuando se realicen otros cambios a alguna de las condiciones financieras del Contrato y que no correspondan a una corrección de reporte, tales como: fechas de vencimiento, montos pactados, precios pactados, precios referenciales de mercado a utilizar en caso de compensación, cambios en la modalidad de entrega y liquidación, y cambios en las partes compradora o vendedora por causales distintas de cesión. 2.2.4 Corrección de reporte: Rectificación de información enviada previamente por el Participante que no corresponda a una modificación contractual. **2.3 Término** Corresponde al evento de terminación o pérdida de vigencia de una operación reportada previamente por el Participante, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados. 2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación: Caducidad o término de forma anticipada del Contrato por causales contempladas en el Contrato respectivo, por causa legal, acuerdo de las partes, incluyendo la compresión u optimización de cartera. 2.3.2 Cesión: Transferencia a un tercero de un Contrato previamente reportado por el Participante (cedente).	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
					2.3.3 Anulación: Eliminación de la información referida a un Contrato informado previamente, debido a que este nunca existió (ej. duplicaciones, cotizaciones, error de información, entre otros) o bien no estaba afecto a la regulación de derivados de monedas del Capítulo III.D.3 del CNF y su respectivo Reglamento Operativo. 2.3.4 Vencimiento: Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha de término del Contrato, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vencidos, junto con la información de pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior. **2.4 Vigencia** Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha del reporte, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vigentes, junto con la información sobre valorizaciones, garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior.		
			4	LEI contraparte 1	Código LEI (*Legal Entity Identifier*) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas, si lo tuviere.	Char(20)	Sí, cuando Contraparte 1 no posee código LEI.
			5	RUT contraparte del participante (Contraparte 2)	RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar.	Varchar(10)	Sí, solo cuando la contraparte 2 es extranjera.
			6	LEI contraparte 2	Código LEI *(Legal Entity Identifier*) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar, si lo tuviere.	Char(20)	Sí, solo cuando la contraparte 2 es local y distinta de un Fondo administrado por una AGF o AFP que pose código LEI.
			7	Nombre o razón social contraparte 2	Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.	Varchar(150)	No
			8	País Contraparte 2	Código del país de residencia o domicilio de la Contraparte 2, de acuerdo con la norma ISO 3166-1 alpha-3 3166-1 alpha-3.	Char(3)	No
			9	RUT de Entidad de Contraparte Central	RUT (Rol único Tributario) de la Entidad de Contraparte Central establecida en Chile conforme a la Ley N° 20.345, a través de la cual se haya convenido realizar la liquidación de las obligaciones correspondientes al Contrato.	Varchar(9)	Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte Central local.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			10	LEI de Entidad de Contraparte Central	Código LEI (*Legal Entity Identifier),* si lo tuviere, asignado a la Entidad de Contraparte Central a través de la cual se haya convenido realizar la liquidación de las obligaciones correspondientes al Contrato.	Char(20)	Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte Central local o extranjera.
			11	RUT Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1	En el caso de que un Contrato sea liquidado en una Entidad de Contraparte Central u otro agente liquidador, y que la Contraparte 1 no sea miembro de dicha entidad, se debe indicar el RUT (Rol Único Tributario) de quien opera como Participante Directo o bien como Agente Liquidador de la Contraparte 1 ante la Entidad de Contraparte Central.	Varchar(9)	Sí, cuando información no aplica.
			12	LEI Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1	En el caso de que un Contrato sea liquidado en una Entidad de Contraparte Central u otro agente liquidador, y que la Contraparte 1 no sea miembro de dicha entidad, se debe indicar el Código LEI (*Legal Entity Identifier*) asignado a la entidad que opera como Participante Directo o bien como Agente Liquidador de la Contraparte 1 ante la Entidad de Contraparte Central.	Char(20)	Sí, cuando información no aplica.
			13	RUT Agente de Cálculo	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato.	Varchar(9)	Sí, cuando el Agente de Cálculo no es local.
			14	LEI Agente de Cálculo	Código LEI (*Legal Entity Identifier*), si lo tuviere, asignado a la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato.	Char(20)	Sí, cuando el Agente de cálculo no posee un LEI
			15	Nombre o Razón Social Agente de Cálculo	Nombre o razón social de la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato.	Varchar(150)	No
			16	RUT del Cedente o Cesionario	RUT (Rol Único Tributario) de la Contraparte domiciliada o residente en Chile que cede (evento suscripción 2.1.2 “Adquisición por Cesión”, evento de modificación 2.2.2 “Modificación de Contraparte por Cesión”) o a la que se cede (evento término 2.3.2 “Cesión”) un Contrato. Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.	Varchar(9)	Sí, cuando evento de reporte es distinto de CES y ACS o el Cedente o Cesionario no es local.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			17	LEI Cedente o Cesionario	Código LEI (*Legal Entity Identifier*), si lo tuviere, asignado a la Contraparte que cede (Evento Suscripción 2.1.2 "Adquisición por Cesión", Evento de Modificación 2.2.2 "Modificación de Contraparte por Cesión") o a la que se cede (Evento Término 2.3.2 "Cesión") un Contrato. Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.	Char(20)	Sí, cuando el evento de reporte es distinto de CES y ACS, o el Cedente o Cesionario no posee un código LEI.
			56	Plataforma de Negociación	Código de la Plataforma de Negociación en la cual fue pactado el contrato de derivado, según código MIC (*Market Identifier Code*) de la norma ISO 10383. En el caso que el contrato fuese negociado fuera de Bolsa, se deberá indicar en este campo el código "OTC".	Char(4)	No
			57	RUT Intermediario	RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario (*Broker*) que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Varchar(9)	Sí, cuando la información no aplica.
			58	LEI Intermediario	Código LEI (*Legal Entity Identifier*), si lo tuviere, del *Broker* que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Char(20)	Sí, cuando la información no aplica.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
	02				**Tipo de registro**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	33	Fecha y hora de suscripción del contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			21	Instrumento	Tipo de instrumento al que corresponde la operación informada, según la Tabla de Instrumentos.	Char(3)	No
			19	Identificador del contrato para agente autorizado	Código único asignado por el Agente Autorizado a cada Contrato suscrito por el Participante. Este campo puede ser informado solo cuando el envío de información al SIID sea realizado por un Agente Autorizado a nombre del Participante.	Varchar(52)	Sí, cuando no aplica
			22	Opciones: Clase	Clase de opción a que corresponde la operación informada, de acuerdo con la modalidad de ejercicio pactada en el Contrato, según lo señalado en la Tabla Clase de Opción.	Char(2)	Sí, cuando el instrumento no es una opción.
			23	Opciones: Posición en la operación	Indicar si la Contraparte 1 asume la posición compradora o vendedora en la opción, según lo señalado en la Tabla Tipo de Posición.	Char(4)	Sí, cuando el instrumento no es una opción.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			25	Modalidad de liquidación	Modalidad estipulada en el Contrato para llevar a cabo los pagos o liquidaciones de principales que éste origine, la cual puede ser por compensación o entrega física, según lo señalado en la Tabla Modalidad de Liquidación	Char(2)	No
			26	Moneda de compensación	Código de la moneda en la cual se realiza la compensación, según norma ISO 4217, en caso de haberse pactado dicha modalidad de liquidación.	Char(3)	Sí, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física.
			34	Fecha de inicio	Fecha en la cual comienzan a devengarse los intereses de la operación en favor de alguna de las contrapartes. Este campo se debe completar cuando hay un único flujo. En el caso de haber más intercambios se debe indicar la fecha de inicio para cada uno de los flujos en la sección de calendario de flujos.	Date	Sí, solo si N° de intercambios o flujos es mayor a 1.
			35	Fecha *fixing* 1	Fecha que se considera para el tipo de cambio, precio o índice de referencia utilizado en el cálculo de la compensación del derivado, según se estipule en el Contrato. En el caso de haber más intercambios se debe indicar la fecha de fixing para cada uno de los flujos en la sección de calendario de flujos. Para un instrumento “asiático” será la fecha inicial del período de fechas a considerar en el *fixing*. Para un instrumento "americano" o "bermuda", esta fecha será la primera en la cual podrá ser ejercido el derecho.	Date	Sí, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1.
			37	Fecha de término	Fecha en la cual vence o madura la operación de acuerdo con lo establecido originalmente en el Contrato. En el caso de un anticipo se debe reportar la nueva fecha de término en el campo “Fecha Efectiva de Término o Liquidación Anticipada”.	Date	No
			38	Fecha de pago de la operación	Fecha de la última liquidación de la operación.	Date	No
			39	Fecha de inicio de la Modificación	Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una Modificación.	Date	Sí, cuando el evento de reporte no es una modificación.
			43	Moneda de prima/pago inicial	Si la operación corresponde a una Opción o involucra el pago de una prima o un monto compensatorio entre las partes al inicio del Contrato, se debe indicar la moneda de dicho pago. En el caso de tratarse de un evento de reporte que consista en la “adquisición por cesión” de un Contrato, si el Participante (Contraparte 1) ha entregado o recibido un pago debe indicar la moneda de este. Se debe indicar el código de la moneda, según norma ISO 4217.	Char(3)	Sí, solo cuando no se ha informado Monto prima/pago inicial recibida ni Monto prima/pago inicial entregada

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			44	Monto prima/pago inicial recibida(o)	Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos en caso de tratarse de la "adquisición por cesión" del Contrato.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay una prima o pago inicial recibido.
			45	Monto prima/pago inicial entregada(o)	Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos en caso de tratarse de la "adquisición por cesión" del Contrato.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay una prima o pago inicial entregado.
			48	Objetivo de la operación	Indicar el objetivo de la operación para la Contraparte 1, según lo indicado en la Tabla Objetivo de la Operación. Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá reportar esta clasificación de acuerdo con la norma sectorial correspondiente.	Char(3)	No
			49	Convenio Marco	Este campo permite un máximo de 25 caracteres, de los cuales los primeros cuatro caracteres corresponden al convenio marco definido en la Tabla Convenio Marco y en los restantes caracteres se debe indicar el número o código único asignado al Convenio Marco de contratación de derivados.	Char(25)	No
			50	País Jurisdicción del Contrato	Código del país correspondiente a la legislación y jurisdicción aplicable bajo la cual el Contrato está amparado, de acuerdo con la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)	No
			51	Garantías	Indicar si la operación cuenta con garantías asociadas al cumplimiento de las obligaciones que la misma comprende, según lo indicado en la Tabla de Garantías.	Char(4)	No
			52	Cláusula de Recouponing	Indicar si la operación considera o no cláusula de Recouponing en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de Recouponing.	Char(1)	No
			53	Cláusula de término anticipado	Indicar si la operación fue pactada o no con cláusula de término (ya sea obligatoria o voluntaria) y exigibilidad anticipada de obligaciones para la Contraparte 1, Contraparte 2, o cualquiera de las partes, según Tabla Cláusula de Término Anticipado.	Char(3)	No
			54	Fecha de efectiva de término o liquidación anticipada	Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.	Date	Sí, cuando el contrato no ha sido anticipado.
			55	Compresión de cartera o Recouponing	Identificar si el nuevo Contrato o el término anticipado de uno previamente informado es resultado o no de una compresión/optimización de cartera, o bien es resultado de un Recouponing.	Char(1)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			59	Número total de intercambios o flujos	Número total de oportunidades (fechas) en las que se ha convenido efectuar liquidaciones correspondientes a intercambio de flujo y/o nocional. Los intercambios Spot no deben ser informados en este Sistema. En el caso de operaciones que comprenden más de un intercambio a futuro, estos deberán ser detallados a continuación en la sección de Calendario de Flujos. Para un instrumento que se compone de un único intercambio o liquidación a futuro, este campo debe ser reportado con valor 1.	Num(4)	No
			80	Número total de registros de pagos	Número total de registros de pagos que serán informados para la operación, los cuales deberán ser detallados a continuación. En el caso de agrupar (netear) distintos eventos de pagos, estos deberán corresponder a un mismo tipo, de acuerdo con la Tabla Tipo de Pago Efectuado	Num(5)	No (no aplica a archivos diarios).

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
	03				**Tipo de registro**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	33	Fecha y hora de suscripción del contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			24	Opciones: Instrumento subyacente	Indicar si el ejercicio de la opción implica la entrada en vigencia de un nuevo derivado (ejemplo *swaption*). Si este es el caso, reportar el instrumento subyacente correspondiente, según lo señalado en la Tabla Opciones - Instrumento Subyacente.	Char(3)	Sí, solo si el instrumento no es una opción sobre un derivado.
			27	Moneda Comprada	Código de la moneda subyacente a recibir por la Contraparte 1 en cada fecha de pago o al término de la operación, según norma ISO 4217.	Char(3)	No
			28	Monto Moneda Comprada	Monto de la moneda subyacente a recibir por la Contraparte 1 al término de la operación.	Num(15,5)	Sí, solo si instrumento tiene un precio desconocido y Monto Moneda Vendida fue informado.
			29	Moneda Vendida	Código de la moneda subyacente a entregar por la Contraparte 1 en cada fecha de pago o al término de la operación, según norma ISO 4217	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			30	Monto Moneda Vendida	Monto de la moneda subyacente a entregar por la Contraparte 1 al término de la operación.	Num(15,5)	Sí, solo si instrumento tiene un precio desconocido y Monto Moneda Comprada fue informado.
			31	Tipo de Tasa de Interés a recibir	Indicar si la tasa de interés recibida por la Contraparte 1 es fija o una de tipo variable, según lo señalado en la Tabla Tipo de Tasa de Interés.	Varhhar(7)	Sí, solo si el instrumento no posee intercambio de intereses.
			32	Tipo de Tasa de Interés a entregar	Indicar si la tasa de interés entregada por la Contraparte 1 es fija o una de tipo variable, según lo señalado en la Tabla Tipo de Tasa de Interés.	Varchar(7)	Sí, solo si el instrumento no posee intercambio de intereses.
			36	Fecha *fixing* 2	Fecha final del período a considerar en el *fixing* de una operación "asiática", o bien la última en la cual podrá ser ejercido el derecho de una operación "americana" o "bermuda".	Date	Sí, cuando la liquidación es por entrega física o es por compensación con una única fecha de fixing.
			40	Convención Tipo de Cambio	Convención de tipo de cambio definida en el Contrato para expresar la información de precios de la operación, utilizando los códigos ISO 4217 para las monedas involucradas separados por el signo "/".	Char(7)	No
			41	Precio Pactado a Futuro (Tipo Cambio Futuro)	Tipo de cambio a futuro, el cual debe ser expresado conforme a la "Convención Tipo de Cambio" definida en el Contrato. Para el caso de una opción, este campo corresponde al Precio Strike. Para operaciones que se suscriban con precio futuro desconocido al momento de su cierre, este campo no deberá ser completado. Al momento de conocerse el precio de intercambio, este deberá ser informado mediante una modificación.	Num(15,5)	Sí, cuando el precio pactado es desconocido.
			42	Puntos Forward	Diferencia entre el Precio Pactado a Futuro y el Precio Spot considerado en la negociación.	Num(4,10)	Sí, para instrumentos distintos de FWD.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			46	Precio barrera de entrada (*Knock-in*)	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción podrá ser ejercida. Debe ser informado cuando la operación corresponda a una opción con barrera del tipo "*up-and-in*" o "*down-and-in*". En el primer caso, el precio del subyacente debe subir hasta un determinado nivel (el precio barrera de entrada) para que el derecho que confiere el instrumento se active o sea ejercido; en el segundo caso, el precio del subyacente debe bajar hasta un determinado nivel para que la opción sea válida (precio barrera de entrada).	Num(15,5)	Sí, cuando la información no aplica.
			47	Precio barrera de salida (*Knock-out*)	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción no podrá ser ejercida. Debe ser informado cuando la operación corresponda a una opción con barrera del tipo "*up-and-out*" o "*down-and-out*". En el primer caso, la opción solo puede ejercerse válidamente mientras el precio del subyacente no alcance un determinado nivel (el precio barrera de salida); en el segundo caso, el precio del subyacente se debe mantener sobre un determinado nivel (precio barrera de salida) para que la opción se mantenga activa o sea ejercida.	Num(15,5)	Sí, cuando la información o aplica.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
1.B. Calendario de Flujos							
	04				**Tipo de registro**	**Char(2)**	**No**
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	33	Fecha y hora de suscripción del contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cua las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			60/70	Número del flujo	Correlativo del número del flujo a recibir/entregar a futuro por la Contraparte 1, ya sea por intercambio del principal o pago de intereses.	Num(4)	No
				Tipo de flujo	Código del tipo de flujo que se está reportando. E: entrega - R: recibido	Char(1)	No
			61/71	Factor sobre Tasa de Interés Variable	Factor que multiplica la tasa variable que recibe/entrega la Contraparte 1.	Num(4,3)	Sí, cuando la información no aplica.
			62/72	*Spread* sobre tasa de interés variable	*Spread* que recibe/entrega la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable	Num(4,10)	Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es fija.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			63/ 73	Tasa de interés fija	Tasa de interés fija a recibir/entregar por la Contraparte 1.	Num(4,10)	Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al fujo es variable.
			64/74	Fecha de *fixing* para tasa de interés	Fecha que se considera para la tasa de interés variable de referencia utilizada en el cálculo de intereses del flujo a recibir/entregar por la Contraparte 1, según se estipule en el Contrato.	Date	Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es fija.
			65/75	Fecha de inicio del flujo	Fecha de inicio del período durante el cual se devengarán los intereses del flujo a recibir/Entregar por la Contraparte 1.	Date	No
			66/76	Fecha de término del flujo	Fecha de término del período durante el cual se devengarán intereses para el flujo que será recibido/entregado por la Contraparte 1.	Date	No
			67/77	Monto nocional aplicable al flujo	Monto nocional que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a recibir/entregar por la Contraparte 1.	Num(15,5)	No
			68/78	Monto flujo como intercambio del capital	Monto recibido/entregado por la Contraparte 1 en el flujo respectivo, producto del intercambio de capital o principal.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay intercambio de capital.
			69/79	Moneda del monto como intercambio de capital	Código de la moneda del monto a recibir/entregar como intercambio de capital o principal, según norma ISO 4217.	Char(3)	Sí, solo cuando no hay intercambio de capital.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
2. Pagos del Periodo							
	05			**Tipo de registro**	**Esta sección se debe completar cuando aplica informar pagos efectivos**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	33	Fecha y hora de suscripción del contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			81	Correlativo de registro de pago	Correlativo del registro de pago a informar.	Num(5)	No
				Pago recibido/entregado (R/E)	Código del tipo de pago que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			82	Fecha de pago	Fecha de pago o liquidación. En el caso de informar más de un pago como registro agrupado, indicar la fecha correspondiente al pago más reciente.	Date	No
			83/84	Monto pago (recibido/entregado)	Monto recibido/entregado por la Contraparte 1, de acuerdo con lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor correspondiente al pago total generado por la estructura de derivados en cada uno de los instrumentos que la componen.	Num(15,5)	No
			85	Tipo de pago efectuado	Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado.	Char(1)	No
			86	Moneda de pago	Código de la moneda del pago realizado, según norma ISO 4217.	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
3. Garantías							
	06			**Tipo de registro**	**Esta sección se debe completar cuando aplica informar garantías o umbrales.**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	33	Fecha y hora de suscripción del contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			87	Moneda de valorización de la garantía	Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Char(3)	Sí, cuando no hay garantías a informar.
			88/92	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida/entregada	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas que respaldan el Contrato. Este código debe ser repetido para todas las operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a monedas y, por lo tanto, informadas en otros sistemas de este RO. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Varchar(52)	Sí, cuando no hay garantías a informar

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			90/94	Monto umbral ("*Threshold*") recibida/entregada	Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 2 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de *recouponing*. Este monto debe estar expresado en la misma moneda en la cual será informado el Valor de Mercado de la operación (Sección 4). En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay un umbral pactado
			91/95	Valor garantía (recibida/ entregada	Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas, vigentes al cierre del mes, constituidas a favor o por la Contraparte 1 en caución de las operaciones reportadas, una vez realizado los descuentos pactados aplicables ("*haircut*"). En el caso de que otras operaciones sean respaldadas por esta misma garantía o portafolio se debe repetir este valor para cada una de ellas. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay garantías a informar

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
	07			**Tipo de registro**	**Esta sección se debe completar cuando aplica informar garantías**	Char(2)	
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	33	Fecha y hora de suscripción del contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			88,92	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida/entregada	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías entregadas/recibidas que respaldan el Contrato. Este código debe ser repetido para todas las operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a monedas y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Varchar(52)	No
			89;93	Tipo activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Char(4)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			89;93	Porcentaje tipo de activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Num(3)	No
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
4. Valor de Mercado							
	08				**Tipo de registro**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	33	Fecha y hora de suscripción del contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de operaciones estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			96	Método de valorización	Indicar si la valorización fue realizada utilizando precios de mercado (*mark-to-market*), modelos de cálculo (*mark-to-model*), fue efectuada por una Entidad de Contraparte Central, conforme a la Ley N° 20.345, o a través de otro método de valorización, según lo indicado en la Tabla Método de Valorización.	Char(1)	No
			97	Moneda de valorización	Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.	Char(3)	No
			98	Valor de mercado	Valor de mercado o valor razonable neto del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen. Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá expresar el valor de mercado en base a las normas sectoriales definidas por el supervisor respectivo.	Num(15,5)	No

			99	Opciones: Volatilidad implícita	Indicar la volatilidad implícita utilizada en la determinación del valor razonable de la opción. Cuando exista profundidad en este mercado, se reportará volatilidad implícita, en caso contrario, volatilidad histórica.	Num(4,10)	Sí, cuando la información no aplica.
			100	Opciones: Delta	En este campo se informará el cambio que tendría el Valor de Mercado del Contrato (V) si el precio del subyacente (S) varía en +1% respecto de su valor vigente (Delta: Δ = ∂V/∂S).	Num(4,10)	Sí, cuando la información o aplica.
			101	Opciones: Gamma	En este campo se informará el cambio que tendría Delta (Δ) si el precio del subyacente (S) varía en +1% respecto de su valor vigente (Gamma: Γ = ∂Δ/∂S = ∂2V/∂S2).	Num(4,10)	Sí, cuando la información no aplica.
			102	Opciones: Vega	En este campo se informará el cambio que tendría el Valor de Mercado del Contrato (V) si la volatilidad anualizada del subyacente (σ) varía en +1 punto porcentual respecto del valor utilizado en la valoración de la opción (Vega: ν = ∂V/∂σ).	Num(4,10)	Sí, cuando la información no aplica.
			105	Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte (*Credit value adjustement*t	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2. En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones respecto de la Contraparte 2, o un grupo de contrapartes, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)	Sí, cuando la información no aplica.
			106	Ajuste a la valorización por *BID-OFFER Spread*	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por *BID-OFFER Spread* de la cartera de contratos de derivados de monedas, para la Contraparte 1. En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)	Sí, cuando la información no aplica.
			107	Otros ajustes a la valorización	Indicar monto de otros ajustes al Valor de Mercado Neto de la cartera de contratos de derivados de monedas de la Contraparte 1, distintos a los informados en los campos anteriores. En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)	Sí, cuando la información no aplica.
			103	Valor de Mercado Activo	Valor de mercado o valor razonable de la parte “activa” del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización.	Num(15,5)	No
			104	Valor de Mercado Pasivo	Valor de mercado o valor razonable de la parte “pasiva” del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización.	Num(15,5)	No

ANEXO 2.B: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE TASAS DE INTERÉS

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
1.A. Información general							
	01				**Tipo de registro**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	31	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			1	Naturaleza de la información	Debe precisarse si los antecedentes que conforman el respectivo Evento de Reporte, se entregan o no al BCCh en cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos I y IX del CNCI, o en la normativa cambiaria sobre operaciones con instrumentos derivados, que en el futuro pueda modificar o sustituir dicha regulación, según Tabla Naturaleza de la Operación.	Char(1)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			2	Evento de reporte	Código que identifica el tipo de registro que será informado o reportado, según la Tabla Eventos de Reporte. Este podrá corresponder a: **2.1 Suscripción** 2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante. 2.1.2 Adquisición por cesión: Cuando el Participante asume las obligaciones y es cesionario de los derechos vinculados a un Contrato suscrito anteriormente por un tercero. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la celebración de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar un evento de suscripción para cada instrumento comprendido en la estructura. **2.2 Modificación** Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante. 2.2.1 Recouponing: Modificación de las condiciones financieras de un Contrato a consecuencia de pagos que hacen las partes con el objeto de modificar su valor razonable (mark to market). 2.2.2 Modificación de contraparte por cesión: El Participante que permanece en el Contrato cedido debe informar que su contraparte ha cambiado producto de una cesión. No procederá informar como cesión la novación de las obligaciones de un Contrato producto de la compensación y liquidación de estas mismas en una entidad de Entidad de Contraparte Central. 2.2.3 Otras modificaciones: Cuando se realicen otros cambios a alguna de las condiciones financieras del Contrato y que no correspondan a una corrección de reporte, tales como: fechas de vencimiento, montos pactados, precios pactados, precios referenciales de mercado a utilizar en caso de compensación, cambios en la modalidad de entrega y liquidación, y cambios en las partes compradora o vendedora por causales distintas de cesión. 2.2.4 Corrección de reporte: Rectificación de información enviada previamente por el Participante que no corresponda a una modificación contractual. **2.3 Término** Corresponde al evento de terminación o pérdida de vigencia de una operación reportada previamente por el Participante, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
					2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación: Caducidad o término de forma anticipada del Contrato por causales contempladas en el Contrato respectivo, por causa legal, acuerdo de las partes, incluyendo la compresión u optimización de cartera. 2.3.2 Cesión: Transferencia a un tercero de un Contrato previamente reportado por el Participante (cedente). 2.3.3 Anulación: Eliminación de la información referida a un Contrato informado previamente, debido a que este nunca existió (ej. duplicaciones, cotizaciones, error de información, entre otros) o bien no estaba afecto a la regulación de derivados de monedas del Capítulo III.D.3 del CNF y su respectivo Reglamento Operativo. 2.3.4 Vencimiento: Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha de término del Contrato, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vencidos, junto con la información de pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior. **2.4 Vigencia** Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha del reporte, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vigentes, junto con la información sobre valorizaciones, garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior.		
			4	LEI Contraparte 1	Código LEI (*Legal Entity Identifier*) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas, si lo tuviere.	Char(20)	Sí, cuando Contraparte 1 no posee código LEI
			5	RUT Contraparte del Participante (Contraparte 2)	RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar.	Varchar(10)	Sí, solo si la contraparte 2 es extranjera.
			6	LEI Contraparte 2	Código LEI (*Legal Entity Identifier*) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar, si lo tuviere.	Char(20)	Sí, solo si la contraparte 2 es local y distinta de un Fondo administrado por una AGF o AFP que pose código LEI
			7	Nombre o Razón Social Contraparte 2	Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.	Varchar(150)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			8	País Contraparte 2	Código del país de residencia o domicilio de la Contraparte 2, de acuerdo con la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)	No
			9	RUT de Entidad de Contraparte Central	RUT (Rol único Tributario) de la Entidad de Contraparte Central establecida en Chile conforme a la Ley N° 20.345, a través de la cual se haya convenido realizar la liquidación de las obligaciones correspondientes al Contrato.	Varchar(9)	Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte Central local.
			10	LEI de Entidad de Contraparte Central	Código LEI (*Legal Entity Identifier*), si lo tuviere, asignado a la Entidad de Contraparte Central a través de la cual se haya convenido realizar la liquidación de las obligaciones correspondientes al Contrato.	Char(20)	Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte Central local o extranjera.
			11	RUT Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1	En el caso de que un Contrato sea liquidado en una Entidad de Contraparte Central u otro agente liquidador, y que la Contraparte 1 no sea miembro de dicha entidad, se debe indicar el RUT (Rol Único Tributario) de quien opera como Participante Directo o bien como Agente Liquidador de la Contraparte 1 ante la Entidad de Contraparte Central.	Varchar(9)	Sí, cuando información no aplica.
			12	LEI Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1	En el caso de que un Contrato sea liquidado en una Entidad de Contraparte Central u otro agente liquidador, y que la Contraparte 1 no sea miembro de dicha entidad, se debe indicar el Código LEI (*Legal Entity Identifier*) asignado a la entidad que opera como Participante Directo o bien como Agente Liquidador de la Contraparte 1 ante la Entidad de Contraparte Central, si lo tuviere.	Char(20)	Sí, cuando información no aplica.
			13	RUT Agente de Cálculo	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato.	Varchar(9)	Sí, cuando el Agente de Cálculo no es local
			14	LEI Agente de Cálculo	Código LEI (*Legal Entity Identifier*), si lo tuviere, asignado a la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato	Char(20)	Sí, cuando el Agente de cálculo no posee un LEI

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			15	Nombre o Razón Social Agente de Cálculo	Nombre o razón social de la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato.	Varchar(150)	No
			16	RUT del Cedente o Cesionario	RUT (Rol Único Tributario) de la Contraparte domiciliada o residente en Chile que cede (evento suscripción 2.1.2 "Adquisición por Cesión", evento de modificación 2.2.2 "Modificación de Contraparte por Cesión") o a la que se cede (evento término 2.3.2 "Cesión") un Contrato. Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.	Varchar(9)	Sí, cuando el evento de reporte es distinto de CES y ACS, o el Cedente o Cesionario no posee un código LEI.
			17	LEI Cedente o Cesionario	Código LEI (*Legal Entity Identifier*), si lo tuviere, asignado a la Contraparte que cede (Evento Suscripción 2.1.2 "Adquisición por Cesión", Evento de Modificación 2.2.2 "Modificación de Contraparte por Cesión") o a la que se cede (Evento Término 2.3.2 "Cesión") un Contrato. Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.	Char(20)	Sí, cuando el evento de reporte es distinto de CES y ACS o el Cedente o Cesionario no posee un código LEI.
			54	Plataforma de Negociación	Código de la Plataforma de Negociación en la cual fue pactado el contrato de derivado, según código MIC (*Market Identifier Code*) de la norma ISO 10383. En el caso que el contrato fuese negociado fuera de Bolsa, se deberá indicar en este campo el código "OTC".	Char(4)	No
			55	RUT Intermediario	RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario (Broker) que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Varchar(9)	Sí, cuando la información no aplica.
			56	LEI Intermediario	Código LEI (*Legal Entity Identifier*), si lo tuviere, del Broker que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Char(20)	Sí, cuando la información no aplica.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
	02				**Tipo de registro**	**Char(2)**	**No**
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	31	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime9)	No
		SÍ	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			21	Instrumento	Tipo de instrumento al que corresponde la operación informada, según la Tabla de Instrumentos.	Char(3)	No
			19	Identificador del contrato para agente autorizado	Código único asignado por el Agente Autorizado a cada Contrato suscrito por el Participante. Este campo puede ser informado solo cuando el envío de información al SIID sea realizado por un Agente Autorizado a nombre del Participante.	Varchar(52)	Sí, cuando no aplica.
			22	Opciones: Clase	Clase de opción a que corresponde la operación informada, de acuerdo con la modalidad de ejercicio pactada en el Contrato, según lo señalado en la Tabla Clase de Opción.	Char(2)	Sí, solo si el instrumento no es una opción.
			23	Opciones: Posición en la operación	Indicar si la Contraparte 1 asume la posición compradora o vendedora en la opción, según lo señalado en la Tabla Tipo de Posición.	Char(4)	Sí, solo si el instrumento no es una opción.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			25	Modalidad de liquidación	Modalidad estipulada en el Contrato para llevar a cabo los pagos o liquidaciones de principales que éste origine, la cual puede ser por compensación o entrega física, según lo señalado en la Tabla Modalidad de Liquidación	Char(2)	No
			26	Moneda de compensación	Código de la moneda en la cual se realiza la compensación, según norma ISO 4217, en caso de haberse pactado dicha modalidad de liquidación.	Char(3)	Sí, solo si modalidad de liquidación es entrega física.
			32	Fecha de inicio	Fecha en la cual comienzan a devengarse los intereses de la operación en favor de alguna de las contrapartes. Este campo se debe completar para instrumentos distintos de Interest Rate Swap y que consideran un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contrario, se debe indicar la fecha de inicio para cada uno de los flujos en la sección de calendario de flujos. De haber más intercambios se debe indicar la fecha de inicio para cada uno de los flujos en la sección de calendario de pagos.	Date	Sí, solo si el instrumento es SWP o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1.
			33	Fecha de *Fixing*	Fecha que se considera para el tipo de cambio, precio o índice de referencia utilizado en el cálculo de la compensación del derivado, según se estipule en el Contrato. Este campo debe ser informado para instrumentos distintos de Interest Rate Swap y que considera un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contrario se debe indicar la fecha de *fixing* para cada uno de los flujos en la sección de calendario de flujos.	Date	Sí, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física, el instrumento es SWP o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1.
			34	Fecha de término	Fecha en la cual vence o madura la operación de acuerdo con lo establecido originalmente en el Contrato. En el caso de un anticipo se debe reportar la nueva fecha de término en el campo “Fecha Efectiva de Término o Liquidación Anticipada”.	Date	No
			35	Fecha de pago de la operación	Fecha de la última liquidación de la operación.	Date	No
			36	Fecha de inicio de la Modificación	Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una Modificación.	Date	Sí, cuando el evento de reporte no es una modificación.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			41	Moneda de prima/pago inicial	Si la operación corresponde a una Opción o involucra el pago de una prima o un monto compensatorio entre las partes al inicio del Contrato, se debe indicar la moneda de dicho pago. En el caso de tratarse de un evento de reporte que consista en la "adquisición por cesión" de un Contrato, si el Participante (Contraparte 1) ha entregado o recibido un pago debe indicar la moneda de este. Se debe indicar el código de la moneda, según norma ISO 4217.	Char(3)	Sí, solo cuando no se ha informado Monto prima/pago inicial recibida ni Monto prima/pago inicial entregada
			42	Monto prima/pago inicial recibida(o)	Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos en caso de tratarse de la "adquisición por cesión" del Contrato.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay una prima o pago inicial recibido.
			43	Monto prima/pago inicial entregada(o)	Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos en caso de tratarse de la "adquisición por cesión" del Contrato.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay una prima o pago inicial entregado.
			46	Objetivo de la operación	Indicar el objetivo de la operación para la Contraparte 1, según lo indicado en la Tabla Objetivo de la Operación. Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá reportar esta clasificación de acuerdo con la norma sectorial correspondiente.	Char(3)	No
			47	Convenio Marco	Este campo permite un máximo de 25 caracteres, de los cuales los primeros cuatro caracteres corresponden al convenio marco definido en la Tabla Convenio Marco y en los restantes caracteres se debe indicar el número o código único asignado al Convenio Marco de contratación de derivados.	Char(25)	No
			48	País Jurisdicción del Contrato	Código del país correspondiente a la legislación y jurisdicción aplicable bajo la cual el Contrato está amparado, de acuerdo con la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)	No
			49	Garantías	Indicar si la operación cuenta con garantías asociadas al cumplimiento de las obligaciones que la misma comprende, según lo indicado en la Tabla de Garantías.	Char(4)	No
			50	Cláusula de Recouponing	Indicar si la operación considera o no cláusula de Recouponing en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de Recouponing.	Char(1)	No
			51	Cláusula de término anticipado	Indicar si la operación fue pactada o no con cláusula de término (ya sea obligatoria o voluntaria) y exigibilidad anticipada de obligaciones para la Contraparte 1, Contraparte 2, o cualquiera de las partes, según Tabla Cláusula de Término Anticipado.	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			52	Fecha efectiva de término o liquidación anticipada	Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.	Date	Sí, cuando el contrato no ha sido anticipado.
			53	Compresión de cartera o *Recouponing*	Identificar si el nuevo Contrato o el término anticipado de uno previamente informado es resultado de una compresión/optimización de cartera, o bien es resultado de un Recouponing.	Char(1)	No
			57	Número total de intercambios o flujos	Número total de oportunidades (fechas) en las que se ha convenido efectuar liquidaciones futuras correspondientes a intercambio de flujo y/o nocional. En el caso de operaciones que comprende más de un intercambio a futuro o corresponden a instrumentos *Interest Rate Swap*, estos deberán ser detallados a continuación en la sección de Calendario de Flujos. Para un instrumento que se compone de un único intercambio o liquidación a futuro, este campo debe ser reportado con valor 1.	Num(4)	No
			76	Número total de registros de pagos	Número total de registros de pagos que serán informados para la operación, los cuales deberán ser detallados a continuación. En el caso de agrupar (netear) distintos eventos de pagos, estos deberán corresponder a un mismo tipo, de acuerdo con la Tabla Tipo de Pago Efectuado.	Num(5)	No (no aplica a archivos diarios).

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
	03				**Tipo de registro**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (Unique Transaction Identifier), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	31	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			24	Opciones: Instrumento subyacente	Indicar si el ejercicio de la opción implica la entrada en vigencia de un nuevo derivado (ejemplo swaption). Si este es el caso, reportar el instrumento subyacente correspondiente, según lo señalado en la Tabla Opciones - Instrumento Subyacente.	Char(3)	Sí, solo si el instrumento no es una opción sobre un derivado.
			27	Moneda monto nocional	Código de la moneda en la que esta expresado el monto nocional sobre el cual se calculan los intereses a intercambiar, según norma ISO 4217.	Char(3)	No
			28	Monto nocional	Se debe indicar el monto nocional de la operación, sobre el cual se calculan los intereses. Este campo se debe completar cuando hay un único flujo y el instrumento es distinto de *Interest Rate Swap*.	Num(15,5)	SI, solo si instrumento es SWP o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			29	Tipo de Tasa de Interés a recibir	Indicar si la tasa de interés recibida por la Contraparte 1 es fija o una de tipo variable, según lo señalado en la Tabla Tipo de Tasa de Interés.	Varchar(7)	No
			30	Tipo de Tasa de Interés a entregar	Indicar si la tasa de interés entregada por la Contraparte 1 es fija o una de tipo variable, según lo señalado en la Tabla Tipo de Tasa de Interés.	Varchar(7)	No
			37	Tasa de interés fija a recibir	Tasa fija a recibir por la Contraparte 1. Este campo se debe completar solo para instrumentos distintos de Interest Rate Swap y que consideran un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contario se debe indicar la tasa de interés fija a recibir en el campo 61 para cada flujo del calendario de flujo. Para el caso de una Opción, este campo corresponde a la Tasa de interés Strike.	Num(4,10)	Si, solo si el instrumento es SWP, el N° de intercambios o flujos es mayor a 1 o el tipo de tasa de interés a recibir es variable.
			38	Tasa de interés fija a entregar	Tasa fija a entregar por la Contraparte 1. Este campo se debe completar solo para instrumentos distintos de Interest Rate Swap y que consideran un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contario se debe indicar la tasa de interés fija a recibir en el campo 70 para cada flujo del calendario de flujo. Para el caso de una Opción, este campo corresponde a la Tasa de interés Strike.	Num(4,10)	Si, solo si el instrumento es SWP, el N° de intercambios o flujos es mayor a 1 o el tipo de tasa de interés a entregar es variable.
			39	Spread sobre tasa de interés variable a recibir	Spread sobre la tasa variable que recibe la Contraparte 1. Este campo se debe completar solo para instrumentos distintos de Interest Rate Swap y que consideren un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contrario se debe indicar el spread en el campo 60 para cada flujo del calendario de flujos.	Num(4,10)	Si, solo si el instrumento es SWP, el N° de intercambios o flujos es mayor a 1 o el tipo de tasa de interés a recibir es fija.
			40	Spread sobre tasa de interés variable a entregar	Spread sobre la tasa variable que entrega la Contraparte 1. Este campo se debe completar solo para instrumentos distintos de Interest Rate Swap y que consideren un único flujo a intercambiar a futuro. En el caso contrario se debe indicar el spread en el campo 69 para cada flujo del calendario de flujos.	Num(4,10)	Si, solo si el instrumento es SWP, el N° de intercambios o flujos es mayor a 1 o el tipo de tasa de interés a entregar es fija.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			44	Precio barrera de entrada (*Knock-in*)	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual una opción podrá ser ejercida. Debe ser informado cuando la operación corresponda a una opción con barrera del tipo "up-and-in" o "down-and-in". En el primer caso, el precio del subyacente debe subir hasta un determinado nivel (el precio barrera de entrada) para que el derecho que confiere el instrumento se active o sea ejercido; en el segundo caso, el precio del subyacente debe bajar hasta un determinado nivel para que la opción sea válida (precio barrera de entrada).	Num(15,5)	Sí, cuando la información no aplica.
			45	Precio barrera de salida (*Knock-out*)	Precio del subyacente, sobre o bajo el cual la opción no podrá ser ejercida. Debe ser informado cuando la operación corresponda a una opción con barrera del tipo "up-and-out" o "down-and-out". En el primer caso, la opción solo puede ejercerse válidamente mientras el precio del subyacente no alcance un determinado nivel (el precio barrera de salida); en el segundo caso, el precio del subyacente se debe mantener sobre un determinado nivel (precio barrera de salida) para que la opción se mantenga activa o sea ejercida.	Num(15,5)	Sí, cuando la información o aplica.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
1.B. Calendario de Flujos							
	04				**Tipo de registro**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	31	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			58,67	Número del flujo	Correlativo del número del flujo a recibir/entregar a futuro por la Contraparte 1, ya sea por intercambio del principal o pago de intereses.	Num(4)	No
				Tipo de flujo (E: entrega; R: recibido)	Código del tipo de flujo que se está reportando. E: entrega - R: recibido	Char(1)	No
			59, 68	Factor sobre tasa de interés variable	Factor que multiplica la tasa variable que recibe/entrega la Contraparte 1.	Num(4,3)	Sí, cuando la información no aplica
			60, 69	Spread sobre tasa de interés variable	Spread que recibe/entrega la Contraparte 1 sobre la tasa de interés variable	Num(4,10)	Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es fija.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			61, 70	Tasa de interés fija	Tasa de interés fija a recibir/entregar por la Contraparte 1.	Num(4,10)	Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es variable.
			62, 71	Fecha de *fixing* para tasa de interés	Fecha que se considera para la tasa de interés variable de referencia utilizada en el cálculo de intereses del flujo a recibir/entregar por la Contraparte 1, según se estipule en el Contrato.	Date	Sí, cuando el tipo de tasa que aplica al flujo es fija.
			63, 72	Fecha de inicio del flujo	Fecha de inicio del período durante el cual se devengarán los intereses del flujo a recibir/Entregar por la Contraparte 1.	Date	No
			64, 73	Fecha de término del flujo	Fecha de término del período durante el cual se devengarán intereses para el flujo que será recibido/entregado por la Contraparte 1.	Date	No
			65, 74	Monto nocional aplicable al flujo	Monto nocional que se utiliza como referencia para calcular los intereses del flujo a recibir/entregar por la Contraparte 1.	Num(15,5)	No
			66, 75	Monto flujo como intercambio del capital	Monto recibido/entregado por la Contraparte 1 en el flujo respectivo, producto del intercambio de capital o principal.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay intercambio de capital.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
2. Pagos del Periodo							
	05			**Tipo de registro**	**Esta sección se debe completar cuando aplica informar pagos efectivos**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	31	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo con los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			77	Correlativo de registro de pago	Correlativo del registro de pago a informar.	Num(5)	No
				Pago recibido/entregado (R/E)	Código del tipo de pago que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			78	Fecha de pago	Fecha de pago o liquidación. En el caso de informar más de un pago como registro agrupado, indicar la fecha correspondiente al pago más reciente.	Date	No
			79,80	Monto pago (recibido/entregado)	Monto recibido/entregado por la Contraparte 1, de acuerdo con lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor correspondiente al pago total generado por la estructura de derivados en cada uno de los instrumentos que la componen.	Num(15,5)	No
			81	Tipo de pago efectuado	Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado.	Char(1)	No
			82	Moneda de pago	Código de la moneda del pago realizado, según norma ISO 4217.	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
3. Garantías							
	06			**Tipo de registro**	**Esta sección se debe completar cuando aplica informar garantías o umbrales.**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	31	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			82	Moneda de valorización de la garantía	Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Char(3)	Sí, cuando no hay garantías a informar.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			83, 87	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida/entregada	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas que respaldan el Contrato de derivado. Este código debe ser repetido para todas las eventuales operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a tasas de interés y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Varchar(52)	Sí, cuando no hay garantías a informar.
			85, 89	Monto umbral ("*Threshold*") recibido/entregado	Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 2 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de recouponing. Este monto debe estar expresado en la misma moneda en la cual será informado el Valor de Mercado de la operación (Sección 4). En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay un umbral pactado.
			86, 90	Valor garantía (recibida/entregada)	Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas, vigentes al cierre de mes, por la Contraparte 1 como caución de las operaciones reportadas, una vez realizado los descuentos pactados aplicables ("haircut"). En el caso de que otras operaciones sean respaldadas por esta misma garantía o portafolio se debe repetir este valor para cada una de ellas. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay garantías a informar.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
	07			**Tipo de registro**	**Esta sección se debe completar cuando aplica informar garantías**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	31	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un número correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			83, 87	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida/entregada	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas que respaldan el Contrato de derivado. Este código debe ser repetido para todas las eventuales operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a tasas de interés y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Varchar(52)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			84;88	Tipo activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Char(4)	No
			84,88	Porcentaje tipo de activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Num(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
4. Valor de Mercado							
	08				**Tipo de registro**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	31	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
		SÍ	20	Identificador de Operaciones Estructuradas	Este campo debe ser completado cuando se suscriben operaciones estructuradas, en las cuales se utiliza más de un instrumento financiero derivado, de acuerdo a los indicados en la Tabla de Instrumentos (se deben completar tantos registros como instrumentos compongan la estructura financiera del Contrato). Se debe indicar un código correlativo para cada operación individual que conforme la estructura. Cuando la operación no es estructurada se debe informar como cero (0).	Num(2)	No
			91	Método de valorización	Indicar si la valorización fue realizada utilizando precios de mercado (*mark-to-market*), modelos de cálculo (*mark-to-model*), fue efectuada por una Entidad de Contraparte Central, conforme a la Ley N° 20.345, o a través de otro método de valorización, según lo indicado en la Tabla Método de Valorización.	Char(1)	No
			92	Moneda de valorización	Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.	Char(3)	No
			93	Valor de mercado	Valor de mercado o valor razonable neto del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen. Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá expresar el valor de mercado en base a las normas sectoriales definidas por el supervisor respectivo.	Num(15,5)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			94	Opciones: Volatilidad implícita	Indicar la volatilidad implícita utilizada en la determinación del valor razonable de la opción. Cuando exista profundidad en este mercado, se reportará volatilidad implícita, en caso contrario, volatilidad histórica.	Num(4,10)	Sí, cuando la información no aplica.
			95	Opciones: Delta	En este campo se informará el cambio que tendría el Valor de Mercado del Contrato (V) si el precio del subyacente (S) varía en +1% respecto de su valor vigente (Delta: $\Delta = \partial V/\partial S$).	Num(4,10)	Sí, cuando la información no aplica.
			96	Opciones: Gamma	En este campo se informará el cambio que tendría Delta (Δ) si el precio del subyacente (S) varía en +1% respecto de su valor vigente (Gamma: $\Gamma = \partial\Delta/\partial S = \partial 2V/\partial S2$).	Num(4,10)	Sí, cuando la información no aplica.
			97	Opciones: Vega	En este campo se informará el cambio que tendría el Valor de Mercado del Contrato (V) si la volatilidad anualizada del subyacente (σ) varía en +1 punto porcentual respecto del valor utilizado en la valoración de la opción (Vega: $v = \partial V/\partial \sigma$).	Num(4,10)	Sí, cuando la información no aplica.
			101	Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte (*Credit value adjustement*	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2. En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones respecto de la Contraparte 2, o un grupo de contrapartes, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)	Sí, cuando la información no aplica.
			102	Ajuste a la valorización por *BID-OFFER Spread*	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por *BID-OFFER Spread* de la cartera de contratos de derivados de tasas de interés, para la Contraparte 1. En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)	Sí, cuando la información no aplica.
			103	Otros ajustes a la valorización	Indicar monto de otros ajustes al Valor de Mercado Neto de la cartera de contratos de derivados de tasas de interés de la Contraparte 1, distintos a los informados en los campos anteriores. En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)	Sí, cuando la información no aplica.
			99	Valor de Mercado Activo	Valor de mercado o valor razonable de la parte "activa" del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización.	Num(15,5)	No
			100	Valor de Mercado Pasivo	Valor de mercado o valor razonable de la parte "pasiva" del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización.	Num(15,5)	No

ANEXO 2.C: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío
1.A. Información general							
	01				**Tipo de registro**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	32	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime (largo 19)	No
			1	Naturaleza de la información	Debe precisarse si los antecedentes que conforman el respectivo Evento de Reporte, se entregan o no al BCCh en cumplimiento de la normativa cambiaria prevista en los Capítulos I y IX del CNCI, o en la normativa cambiaria sobre operaciones con instrumentos derivados, que en el futuro pueda modificar o sustituir dicha regulación, según Tabla Naturaleza de la Operación.	Char(1)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío
			2	Evento de reporte	Código que identifica el tipo de registro que será informado o reportado, según la Tabla Eventos de Reporte. Este podrá corresponder a: **2.1 Suscripción** 2.1.1 Nuevo Contrato: Corresponde a la celebración de una nueva operación pactada por el Participante. 2.1.2 Adquisición por cesión: Cuando el Participante asume las obligaciones y es cesionario de los derechos vinculados a un Contrato suscrito anteriormente por un tercero. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la celebración de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar un evento de suscripción para cada instrumento comprendido en la estructura. **2.2 Modificación** Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante. 2.2.1 Recouponing: Modificación de las condiciones financieras de un Contrato a consecuencia de pagos que hacen las partes con el objeto de modificar su valor razonable (mark to market). 2.2.2 Modificación de contraparte por cesión: El Participante que permanece en el Contrato cedido debe informar que su contraparte ha cambiado producto de una cesión. No procederá informar como cesión la novación de las obligaciones de un Contrato producto de la compensación y liquidación de las mismas en una entidad de Entidad de Contraparte Central. 2.2.3 Otras modificaciones: Cuando se realicen otros cambios a alguna de las condiciones financieras del Contrato y que no correspondan a una corrección de reporte, tales como: fechas de vencimiento, montos pactados, precios pactados, precios referenciales de mercado a utilizar en caso de compensación, cambios en la modalidad de entrega y liquidación, y cambios en las partes compradora o vendedora por causales distintas de cesión. 2.2.4 Corrección de reporte: Rectificación de información enviada previamente por el Participante que no corresponda a una modificación contractual. **2.3 Término** Corresponde al evento de terminación o pérdida de vigencia de una operación reportada previamente por el Participante, respecto de Contratos vencidos, terminados o ejecutados.	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío
					2.3.1 Caducidad, Término Anticipado o Resciliación: Caducidad o término de forma anticipada del Contrato por causales contempladas en el Contrato respectivo, por causa legal, acuerdo de las partes, incluyendo la compresión u optimización de cartera. 2.3.2 Cesión: Transferencia a un tercero de un Contrato previamente reportado por el Participante (cedente). 2.3.3 Anulación: Eliminación de la información referida a un Contrato informado previamente, debido a que este nunca existió (ej. duplicaciones, cotizaciones, error de información, entre otros) o bien no estaba afecto a la regulación de derivados de monedas del Capítulo III.D.3 del CNF y su respectivo Reglamento Operativo. 2.3.4 Vencimiento: Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha de término del Contrato, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vencidos, junto con la información de pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior. **2.4 Vigencia** Corresponde a las condiciones financieras vigentes a la fecha del reporte, para cada una de las operaciones incluidas en el informe de Contratos Vigentes, junto con la información sobre valorizaciones, garantías y los pagos efectuados en el mes inmediatamente anterior.		
			4	LEI Contraparte 1	Código LEI (*Legal Entity Identifier*) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas, si lo tuviere.	Char(20)	Sí, cuando Contraparte 1 no posee código LEI.
			5	RUT Contraparte del Participante (Contraparte 2)	RUT (Rol Único Tributario) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar.	Varchar(10)	Sí, solo si contraparte 2 es extranjera.
			6	LEI Contraparte 2	Código LEI (*Legal Entity Identifier)* que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar, si lo tuviere.	Char(20)	Sí, solo cuando la contraparte 2 es local, y distinta de un Fondo administrado por una AGF o AFP que pose código LEI.
			7	Nombre o Razón Social Contraparte 2	Nombre o Razón Social de la Contraparte 2.	Varchar(150)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío
			8	País Contraparte 2	Código del país de residencia o domicilio de la Contraparte 2, de acuerdo con la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)	No
			9	RUT de Entidad de Contraparte Central	RUT (Rol único Tributario) de la Entidad de Contraparte Central establecida en Chile conforme a la Ley N° 20.345, a través de la cual se haya convenido realizar la liquidación de las obligaciones correspondientes al Contrato.	Varchar(9)	Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte Central local.
			10	LEI de Entidad de Contraparte Central	Código LEI (*Legal Entity Identifier*), si lo tuviere, asignado a la Entidad de Contraparte Central a través de la cual se haya convenido realizar la liquidación de las obligaciones correspondientes al Contrato.	Char(20)	Sí, cuando el contrato no está bajo una Contraparte Central local o extranjera.
			11	RUT Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1	En el caso de que un Contrato sea liquidado en una Entidad de Contraparte Central u otro agente liquidador, y que la Contraparte 1 no sea miembro de dicha entidad, se debe indicar el RUT (Rol Único Tributario) de quien opera como Participante Directo o bien como Agente Liquidador de la Contraparte 1 ante la Entidad de Contraparte Central	Varchar(9)	Sí, cuando información no aplica.
			12	LEI Participante Directo/Agente Liquidador de la Entidad de Contraparte Central de la Contraparte 1	En el caso de que un Contrato sea liquidado en una Entidad de Contraparte Central u otro agente liquidador, y que la Contraparte 1 no sea miembro de dicha entidad, se debe indicar el Código LEI (*Legal Entity Identifier*) asignado a la entidad que opera como Participante Directo o bien como Agente Liquidador de la Contraparte 1 ante la Entidad de Contraparte Central, si lo tuviere.	Char(20)	Sí, cuando información no aplica.
			13	RUT Agente de Cálculo	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato.	Varchar(9)	Sí, cuando el Agente de Cálculo no es local.
			14	LEI Agente de Cálculo	Código LEI (Legal Entity Identifier), si lo tuviere, asignado a la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato	Char(20)	Sí, cuando el Agente de cálculo no posee un LEI

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío
			15	Nombre o Razón Social Agente de Cálculo	Nombre o razón social de la persona o entidad que actuará como Agente de Cálculo para cuando se pone término al Contrato.	Varchar(150)	No
			16	RUT del Cedente o Cesionario	RUT (Rol Único Tributario) de la Contraparte domiciliada o residente en Chile que cede (evento suscripción 2.1.2 "Adquisición por Cesión", evento de modificación 2.2.2 "Modificación de Contraparte por Cesión") o a la que se cede (evento término 2.3.2 "Cesión") un Contrato. Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.	Varchar(9)	Sí, cuando el evento de reporte es distinto de CES y ACS o el Cedente o Cesionario no es local.
			17	LEI Cedente o Cesionario	Código LEI (Legal Entity Identifier), si lo tuviere, asignado a la Contraparte que cede (Evento Suscripción 2.1.2 "Adquisición por Cesión", Evento de Modificación 2.2.2 "Modificación de Contraparte por Cesión") o a la que se cede (Evento Término 2.3.2 "Cesión") un Contrato. Las novaciones a una Contraparte Central no se incluyen en este campo.	Char(20)	Sí, cuando el evento de reporte es distinto de CES y ACS o el Cedente o Cesionario no posee un código LEI.
			49	Plataforma de Negociación	Código de la Plataforma de Negociación en la cual fue pactado el contrato de derivado, según código MIC (Market Identifier Code) de la norma ISO 10383. En el caso que el contrato fuese negociado fuera de Bolsa, se deberá indicar en este campo el código "OTC".	Char(4)	No
			50	RUT Intermediario	RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario (*Broker*) que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Varchar(9)	Sí, cuando la información no aplica.
			51	LEI Intermediario	Código LEI (Legal Entity Identifier), si lo tuviere, del Broker que actuó como intermediario en el cierre de la operación.	Char(20)	Sí, cuando la información no aplica.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
	02				**Tipo de registro**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	32	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
			25	Instrumento	Tipo de instrumento al que corresponde la operación informada, según la Tabla de Instrumentos.	Char(3)	No
			19	Identificador del contrato para agente autorizado	Código único asignado por el Agente Autorizado a cada Contrato suscrito por el Participante. Este campo puede ser informado solo cuando el envío de información al SIID sea realizado por un Agente Autorizado a nombre del Participante.	Varchar(52)	Sí, cuando no aplica
			26	Opciones: Clase	Clase de opción a que corresponde la operación informada, de acuerdo a la modalidad de ejercicio pactada en el Contrato, según lo señalado en la Tabla Clase de Opción.	Char(2)	Sí, cuando el instrumento no es una opción.
			27	Opciones: Posición en la operación	Indicar si la Contraparte 1 asume la posición compradora o vendedora en la opción, según lo señalado en la Tabla Tipo de Posición.	Char(4)	Sí, cuando el instrumento no es una opción.
			28	Modalidad de liquidación	Modalidad estipulada en el Contrato para llevar a cabo los pagos o liquidaciones de principales que éste origine, la cual puede ser por compensación o entrega física, según lo señalado en la Tabla Modalidad de Liquidación	Char(2)	No
			29	Moneda de compensación	Código de la moneda en la cual se realiza la compensación, según norma ISO 4217, en caso de haberse pactado dicha modalidad de liquidación.	Char(3)	Sí, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física.
			33	Fecha de inicio	Fecha en la cual comienzan a devengarse los intereses de la operación en favor de alguna de las contrapartes.	Date	Sí, solo si el N° de intercambios o flujos es mayor a 1.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			34	Fecha *fixing* 1	Fecha que se considera para la tasa de rendimiento o precio de referencia utilizada en el cálculo del flujo, según se estipule en el Contrato.	Date	Si, cuando la modalidad de liquidación es por entrega física o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1.
			35	Fecha de término	Fecha en la cual vence o madura la operación de acuerdo con lo establecido originalmente en el Contrato. En el caso de un anticipo se debe reportar la nueva fecha de término en el campo “Fecha Efectiva de Término o Liquidación Anticipada”.	Date	No
			36	Fecha de pago de la operación	Fecha de la última liquidación de la operación.	Date	No
			37	Fecha de inicio de la Modificación	Fecha en la cual comienzan a regir las nuevas condiciones del Contrato producto de una Modificación.	Date	Sí, cuando el evento de reporte no es una modificación.
			38	Moneda de prima/pago inicial	Si la operación corresponde a una Opción o involucra el pago de una prima o un monto compensatorio entre las partes al inicio, se debe indicar la moneda de dicho pago. En el caso de tratarse del evento de reporte correspondiente a la “adquisición por cesión” de un contrato, si el Participante (Contraparte 1) ha entregado o recibido un pago debe indicar la moneda de este. Se debe indicar el código de la moneda según norma 4217.	Char(3)	Si, solo cuando no se ha informado Monto prima/pago inicial recibida ni Monto prima/pago inicial entregada
			39	Monto prima/pago inicial recibida(o)	Monto recibido como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los pagos en caso de tratarse de la “adquisición por cesión”.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay una prima o pago inicial recibido.
			40	Monto prima/pago inicial entregada(o)	Monto entregado como prima o pago inicial por la Contraparte 1, incluyendo los en caso de tratarse de la “adquisición por cesión”.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay una prima o pago inicial entregado.
			41	Objetivo de la operación	Indicar el objetivo de la operación para la Contraparte 1, según lo indicado en la Tabla Objetivo de la Operación. Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá reportar esta clasificación de acuerdo a la norma sectorial correspondiente.	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			42	Convenio Marco	Este campo permite un máximo de 25 caracteres, de los cuales los primeros cuatro caracteres corresponden al convenio marco definido en la Tabla Convenio Marco y en los restantes caracteres se debe indicar el número o código único asignado al Convenio Marco de contratación de derivados.	Char(25)	No
			43	País Jurisdicción del Contrato	Código del país correspondiente a la legislación y jurisdicción aplicable bajo la cual el Contrato está amparado, de acuerdo con la norma ISO 3166-1 alpha-3.	Char(3)	No
			44	Garantías	Indicar si la operación cuenta con garantías asociadas al cumplimiento de las obligaciones que la misma comprende, según lo indicado en la Tabla de Garantías.	Char(4)	No
			45	Cláusula de Recouponing	Indicar si la operación considera o no cláusula de Recouponing en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de Recouponing.	Char(1)	No
			46	Cláusula de término anticipado	Indicar si la operación fue pactada o no con cláusula de término (ya sea obligatoria o voluntaria) y exigibilidad anticipada de obligaciones para la Contraparte 1, Contraparte 2, o cualquiera de las partes, según Tabla Cláusula de Término Anticipado.	Char(3)	No
			47	Fecha efectiva de término o liquidación anticipada	Fecha en la cual se realiza la liquidación o el término anticipado del Contrato o su cesión.	Date	Sí, cuando el contrato no ha sido anticipado.
			48	Compresión de cartera o *Recouponing*	Identificar si el nuevo Contrato o el término anticipado de uno previamente informado es resultado o no de una compresión/optimización de cartera, o bien es resultado de un Recouponing.	Char(1)	No
			52	Número total de registros de pagos	Número total de registros de pagos que serán informados para la operación, los cuales deberán ser detallados a continuación. En el caso de agrupar (netear) distintos eventos de pagos, estos deberán corresponder a un mismo tipo de acuerdo con la Tabla de Pago Efectuado.	Num(4)	No (no aplica a archivos diarios).

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
	03				**Tipo de registro**	Char(2)	No
		SI	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SI	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SI	32	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos.	Datetime (largo 19)	No
			30	Moneda monto nocional	Código de la moneda en la que está expresado el monto nocional sobre el cual se calculan los flujos a intercambiar, según norma ISO 4217.	Char(3)	No
			31	Monto nocional	Se debe indicar el monto nocional de la operación.	Num(15,5)	No
			20	Tipo de Identificador del activo de renta fija subyacente	Tipo de identificador del activo de renta fija de acuerdo con lo indicado en la Tabla Tipo de Código de Activo Subyacente. Se debe utilizar de preferencia el código ISIN.	Char(7)	No
			21	Identificador del activo subyacente	Código único de identificación del activo subyacente, según nomenclatura declarada en el campo “Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija Subyacente”.	Char(12)	No
			22	Tasa pactada	Tasa pactada a futuro del activo de renta fija. Para el caso de una opción este campo corresponde a la Tasa Strike.	Num(4,10)	Sí, solo si el precio pactado a futuro fue informado.
			23	Precio Pactado a Futuro	Precio pactado a futuro del activo de renta fija. Para el caso de una opción, este campo corresponde al Precio Strike.	Num(15,5)	Sí, solo si la tasa pactada fue informada.
			24	Posición de la operación	Indicar si la Contraparte 1 asume la posición compradora o vendedora sobre el instrumento de renta fija, cuando se utiliza un instrumento distinto de una opción, según lo señalado en la Tabla Tipo de Posición.	Char(4)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
2. Pagos del Periodo							
	05			**Tipo de registro**	**Esta sección se debe completar cuando aplica informar pagos efectivos**	Char(2)	No
		SI	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SI	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SI	32	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos.	Datetime	No
			53	Correlativo de registro de pago	Correlativo del registro de pago a informar.	Num(5)	No
				Pago recibido/ entregado (R/E)	Código del tipo de pago que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			54	Fecha de pago	Fecha de pago o liquidación. En el caso de informar más de un pago como registro agrupado, indicar la fecha correspondiente al pago más reciente.	Date	No
			55, 56	Monto pago (recibido/entregado)	Monto recibido/entregado por la Contraparte 1, de acuerdo con lo informado en las condiciones financieras correspondientes a la operación reportada. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor correspondiente al pago total generado por la estructura de derivados en cada uno de los instrumentos que la componen.	Num(15,5)	No
			57	Tipo de pago efectuado	Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado.	Char(1)	No
			58	Moneda de pago	Código de la moneda del pago realizado, según norma ISO 4217.	Char(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
	06			**Tipo de registro**	**Esta sección se debe completar cuando aplica informar garantías o umbrales.**	Char(2)	No
		SI	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SI	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SI	32	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato.	Datetime	No
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			58	Moneda de valorización de la garantía	Código de la moneda en que se valoriza la garantía o portafolio de garantías, según norma ISO 4217. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Char(3)	Sí, cuando no hay garantías a informar.
			59, 63	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida/entregada	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas que respaldan el Contrato de derivado. Este código debe ser repetido para todas las eventuales operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a tasas de interés y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Varchar(52)	Sí, cuando no hay garantías a informar.
			61, 65	Monto umbral ("Threshold") Recibido/entregado	Indicar el monto umbral pactado sobre el cual la Contraparte 2 debe constituir garantías o que se activa la cláusula de *recouponing*. Este monto debe estar expresado en la misma moneda en la cual será informado el Valor de Mercado de la operación (Sección 4). En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay un umbral pactado
			62, 66	Valor garantía (recibida/entregada)	Valor de mercado o valor razonable de la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas por la Contraparte 1, vigentes al cierre del mes, como caución de las operaciones reportadas, una vez realizado los descuentos pactados aplicables ("haircut"). En el caso de que otras operaciones sean respaldadas por esta misma garantía o portafolio se debe repetir este valor para cada una de ellas. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Num(15,5)	Sí, cuando no hay garantías a informar.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
	07			**Tipo de registro**	**Esta sección se debe completar cuando aplica informar garantías**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	32	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
				Tipo garantía (E: entregada, R: recibida)	Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido	Char(1)	No
			59, 63	Identificador de la garantía (o portafolio) recibida / entregada	Indicar código único asignado por la Contraparte 1 a la garantía o portafolio de garantías recibidas/entregadas que respaldan el Contrato de derivado. Este código debe ser repetido para todas las eventuales operaciones de derivados que se encuentren respaldadas por esta garantía, incluyendo las que tengan relación con subyacentes distintos a tasas de interés y por lo tanto informadas en otros sistemas de este RO. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Varchar(52)	No
			60;64	Tipo activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Char(4)	No
			60;64	Porcentaje tipo de activo en garantía	Porcentaje de cada tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, respecto al valor de mercado o valor razonable del portafolio de garantías al último día hábil del mes que se está informando, según Tabla Tipo de Activos en Garantía. En el caso de operaciones que se liquidan en Entidad de Contraparte Central conforme a la Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado.	Num(3)	No

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
4. Valor de Mercado							
	08				**Tipo de registro**	Char(2)	No
		SÍ	3	RUT Participante (Contraparte 1)	RUT (Rol Único Tributario) de la persona o entidad obligada a reportar sus operaciones de derivados de monedas (Contraparte 1).	Varchar(9)	No
		SÍ	18	Identificador del Contrato	Código único asignado por el Participante a cada Contrato suscrito. En el caso de disponer de un identificador único de transacción, como el UTI (*Unique Transaction Identifier*), debe ser indicado en este campo. Para una operación estructurada o programa de derivados que comprenda la utilización de dos o más instrumentos (según lo indicado en la Tabla de Instrumentos), se deberá reportar el mismo código para cada una de las operaciones que compone la estructura.	Varchar(52)	No
		SÍ	32	Fecha y hora de suscripción del Contrato	Fecha y hora de cierre de la operación entre el Participante y la Contraparte 2, en que acuerdan las condiciones del Contrato. Cierre de la Operación significa el instante en el cual las partes manifiestan su consentimiento y cierran a firme un Contrato. Cabe señalar que, la hora informada debe ser lo más cercana a la hora en que fueron acordadas las condiciones financieras en el cierre de la operación, considerando un desfase no superior a 15 minutos, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile.	Datetime	No
			67	Método de valorización	Indicar si la valorización fue realizada utilizando precios de mercado (*mark-to-market*), modelos de cálculo (*mark-to-model*), fue efectuada por una Entidad de Contraparte Central, conforme a la Ley N° 20.345, o a través de otro método de valorización, según lo indicado en la Tabla Método de Valorización.	Char(1)	No
			68	Moneda de valorización	Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217.	Char(3)	No
			69	Valor de mercado	Valor de mercado o valor razonable neto del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización. En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen. Si la Contraparte 1 es una entidad sujeta a la supervisión de un regulador de entidades financieras, se deberá expresar el valor de mercado en base a las normas sectoriales definidas por el supervisor respectivo.	Num(15,5)	No
			70	Opciones: Volatilidad implícita	Indicar la volatilidad implícita utilizada en la determinación del valor razonable de la opción. Cuando exista profundidad en este mercado, se reportará volatilidad implícita, en caso contrario, volatilidad histórica.	Num(4,10)	Sí, cuando la información no aplica.
			71	Opciones: Delta	En este campo se informará el cambio que tendría el Valor de Mercado del Contrato (V) si el precio del subyacente (S) varía en +1% respecto de su valor vigente (Delta: $\Delta = \partial V/\partial S$).	Num(4,10)	Sí, cuando la información no aplica.
			72	Opciones: Gamma	En este campo se informará el cambio que tendría Delta (Δ) si el precio del subyacente (S) varía en +1% respecto de su valor vigente (Gamma: $\Gamma = \partial\Delta/\partial S = \partial 2V/\partial S2$).	Num(4,10)	Sí, cuando la información no aplica.

Sub-sección	Tipo de registro	*Primary Key*	N° Campo Sistema o Normativa	Nombre Campo	Descripción	Formato dato	¿Puede venir vacío?
			73	Opciones: Vega	En este campo se informará el cambio que tendría el Valor de Mercado del Contrato (V) si la volatilidad anualizada del subyacente (σ) varía en +1 punto porcentual respecto del valor utilizado en la valoración de la opción (Vega: v = ∂V/∂σ).	Num(4,10)	Sí, cuando la información no aplica.
			77	Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte (*Credit value adjustement*	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2. En el caso que este ajuste sea realizado para una cartera o conjunto de operaciones respecto de la Contraparte 2 o un grupo de contrapartes, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)	Sí, cuando la información no aplica.
			78	Ajuste a la valorización por BID-OFFER Spread	Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por BID-OFFER Spread de la cartera de contratos de derivados de tasas de interés, para la Contraparte 1. En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)	Sí, cuando la información no aplica.
			79	Otros ajustes a la valorización	Indicar monto de otros ajustes al Valor de Mercado Neto de la cartera de contratos de derivados de tasas de interés de la Contraparte 1, distintos a los informados en los campos anteriores. En el caso que este ajuste sea realizado para un conjunto de operaciones, se debe repetir este valor para cada una de las transacciones consideradas en su cálculo.	Num(15,5)	Sí, cuando la información no aplica.
			75	Valor de Mercado Activo	Valor de mercado o valor razonable de la parte “activa” del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización.	Num(15,5)	No
			76	Valor de Mercado Pasivo	Valor de mercado o valor razonable de la parte “pasiva” del contrato, para la Contraparte 1, al último día hábil del mes que se está informando. Este monto no considera ajustes por riesgos a la valorización.	Num(15,5)	No

ANEXO 3: INSTRUCTIVO PARA MODIFICACIÓN DE REPORTES MENSUALES

Resumen

Este documento, tiene por objetivo informar a los Participantes sobre los escenarios en los que es posible realizar el envío de rectificación de información mensual, previamente entregada al SIID-TR, a través de los distintos sistemas o subyacentes (monedas, tasas de interés y renta fija); así como el detalle de la estructura y formato requeridos para dichos archivos de rectificación.
El propósito de los archivos de modificación mensual es regularizar, de manera oportuna y masiva, los eventuales problemas de reportes de información incompleta o con errores, que ocasiona distorsiones en los datos almacenados en el repositorio.

Especificaciones de estructura y formato

Los archivos de modificación de reportes mensuales corresponden a archivos tipo CSV, con la misma estructura que el resto de los archivos mensuales ya definidos en el documento de ***Especificaciones técnicas y tablas relativas al reglamento operativo de sistema integrado de información sobre transacciones de derivados (RO SIID-TR)***, respecto cada tipo de subyacente. Dado la anterior, los nuevos archivos de modificación mensual se rigen por los mismos requerimientos de formato de cada campo, así como reglas de validación asociadas a cada uno de ellos.
La única diferencia de formato entre los archivos mensuales de carga regular y los de modificación mensual, es que para los estos últimos, se debe indicar en el encabezado alguno de los siguientes códigos, según la información mensual a modificar:

111111111**CFX**AAAAMMDD *(aplica al sistema N° 1: Monedas)*
111111111**CIR**AAAAMMDD *(aplica al sistema N° 2: Tasa de interés)*
111111111**CFI**AAAAMMDD *(aplica al sistema N° 3: Renta fija)*

Donde:
111111111: simboliza la posición donde se debe indicar el Rut del Participante que reporta (con dígito verificador, y sin guion ni puntos)
CFI, CFX o CIR: especifica el sistema de información o subyacente al que se refiere la corrección (Renta fija -CFI-, moneda -CFX-, o tasa de interés -CIR-)
AAAAMMDD: corresponde a la fecha del reporte que aplica modificar, esto es año (AAAA) mes (MM) día (DD).

Cabe señalar, que en estos archivos de modificación se debe incluir únicamente la(s) operación(es) que se va a modificar, es decir, no se requiere enviar el set completo de operaciones en cartera vigente o vencidos del informe mensual de referencia.

Códigos de eventos de reporte para correcciones mensuales

Según el tipo de modificación que se desea realizar, existen cuatro nuevos eventos de reporte mensual, los que son incorporados a la Tabla 2: Eventos de Reporte, del presente documento.

Tabla 2: Eventos de Reporte

Descripción	Código	
Nuevo contrato	NUE	
Adquisición por Cesión	ACS	
Modificación por *recouponing*	MRC	
Modificación de contraparte por cesión	MCS	
Otras modificaciones	OMD	
Modificación por corrección de reporte	MCR	
Término por caducidad, anticipo o resciliación	AOC	
Término por cesión	CES	
Término por anulación	ANU	
Mensual operaciones vencidas	MVE	
Mensual operaciones vigentes	MVI	
Mensual rectificación operaciones vigentes	**RVI**	***Nuevo***
Mensual rectificación operaciones vencidas	**RVE**	***Nuevo***
Mensual incorporación operaciones no informadas	**RNU**	***Nuevo***
Mensual anulación de operaciones informadas	**REL**	***Nuevo***

1. **RVI** (Rectificación para contrato vigente)
El evento de reporte RVI se debe utilizar para la modificación o rectificación de cualquiera de las características de contratos informado como vigentes a la fecha del informe (condiciones financieras, pagos, garantías o valores de mercado).
2. **RVE** (Rectificación para contrato vencido)
El evento RVE se debe utilizar para la modificación o rectificación de cualquiera de las características de contratos informados como vencidos a la fecha del informe (condiciones financieras, pagos o garantías).
3. **RNU** (Agregar contrato vigente no enviado anteriormente)
El evento RNU se debe utilizar para la incorporación de contratos que, debiendo ser informados como vigentes o vencidos en el informe mensual, no fueron enviados como tal. Se debe informar en la rectificación toda la información requerida para un contrato vigente o vencido, según corresponda, respecto de las secciones de condiciones financieras, pagos, garantías y valores de mercado.
4. **REL** (Eliminación de un contrato enviado previamente)
Se debe utilizar este evento para la anulación de contratos que se enviaron por error al SIID, cuando no correspondía ser informados. En este tipo de reporte, se debe completar únicamente los campos llave (*o Primary key*) de la sección 1 para los contratos a eliminar, y el correspondiente evento de reporte de anulación mensual "REL".

Ejemplos de archivos de modificación mensual:
Ejemplos de Rectificación para contrato vigente (**RVI**) y para contrato vencido (**RVE**)
En este ejemplo el informante identificado con el rut 22.222.222-2, debe realizar correcciones sobre contratos enviados previamente en el informe MFX del mes de marzo 2022. En primer lugar, desea corregir los montos informados en su contrato vigente Cont_3 y en su contrato vencido Cont_1.
Para esto, debe subir al sistema el archivo .CSV, el cual debe lucir como las imágenes siguientes
Para modificar el contrato vigente:

```
222222222CFX20220331
01;222222222;Cont_3;2021-08-09T12:00:00;0;Y;RVI;1234cod LEI Bco C 899;333333333;;Banco C;CHL;;;;;222222222;1234cod LEI Bco B 899;Banco B;;;OTC;;
02;222222222;Cont_3;2021-08-09T12:00:00;0;FWD;;;;EF;;2021-08-09;;2023-02-13;2023-02-13;;;0.00000;0.00000;NEG;CCGGCont_3;CHL;SC;N;NOT;;N;1;0
03;222222222;Cont_3;2021-08-09T12:00:00;0;;CLP;7932600000.00000;USD;10000000.00000;;;;USD/CLP;793.26000;-4.2600000000;0.00000;0.00000
08;222222222;Cont_3;2021-08-09T12:00:00;0;M;CLP;-191067879.00000;0.0000000000;0.0000000000;0.0000000000;0.0000000000;353606.00000;0.00000;0.00000
```

Para modificar el contrato vencido:

```
222222222CFX20220331
01;222222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;Y;RVE;1234cod LEI Bco C 899;333333333;;Banco C;CHL;;;;;222222222;1234cod LEI Bco B 899;Banco B;;;OTC;;
02;222222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;FWD;;;;EF;;2021-06-24;;2021-10-28;2021-10-28;;;0.00000;0.00000;NEG;CCGGCont_1;CHL;SC;N;NOT;;N;1;2
03;222222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;;CLP;7347500.00000;USD;10000.00000;;;;USD/CLP;734.75000;-1.7500000000;0.00000;0.00000
05;222222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;1;R;2021-10-28;7347500000.00000;C
05;222222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;2;E;2021-10-28;10000000.00000;C
```

Otro ejemplo es agregar un contrato no informado previamente. Abajo se muestra la forma que tendría el archivo .CSV para hacer la rectificación que incorpora el contrato (Cont_5)

```
222222222CFX20220331
01;222222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;Y;RNU;1234cod LEI Bco C 899;333333333;;Banco C;CHL;;;;;222222222;1234cod LEI Bco B 899;Banco B;;;OTC;;
02;222222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;FWD;;;;EF;;2021-07-09;;2021-10-07;2021-10-07;;;0.00000;0.00000;NEG;CCGG3005854;CHL;SC;N;NOT;;N;1;2
03;222222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;;CLP;7487100.00000;USD;10000.00000;;;;USD/CLP;748.71000;-1.7100000000;0.00000;0.00000
05;222222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;2;E;2021-10-07;10000000.00000;C
```

Finalmente, se desea eliminar un contrato ya informado (Cont_2). Para este caso solo se debe ingresar la sección 01 indicando la llave primaria (numero de la sección, Rut contraparte 1, ID del contrato, fecha y hora de suscripción e indicador de operaciones estructuradas) además del código del evento de reporte de eliminación (REL). El resto de los campos de la sección 01 deben ingresarse vacíos. El reporte se verá de esta forma:

```
222222222CFX20220331
01;222222222;Cont_2;2021-07-09T12:00:00;0;;REL;;;;;;;;;;;;;;;;
```

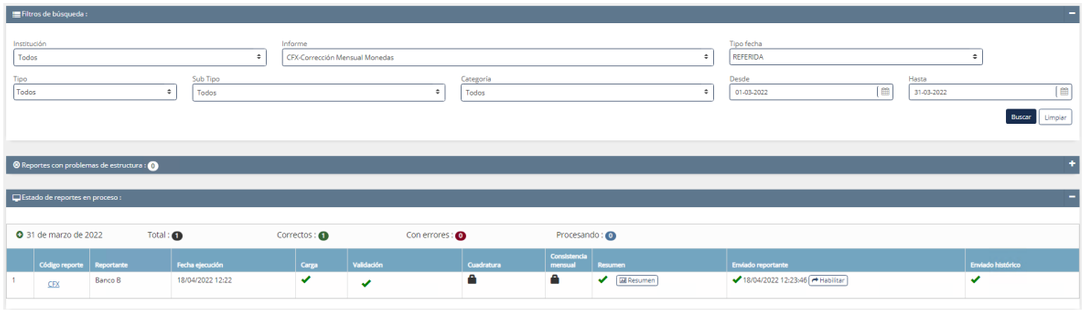
En caso de que todas estas correcciones deban ser incorporadas simultáneamente, se puede subir un solo archivo .CSV que las contenga todas:

```
222222222CFX20220331
01;222222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;Y;RVE;1234cod LEI Bco C 899;333333333;;Banco C;CHL;;;;;222222222;1234cod LEI Bco B 899;Banco B;;;OTC;;
02;222222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;FWD;;;;EF;;2021-06-24;;2021-10-28;2021-10-28;;;0.00000;0.00000;NEG;CCGGCont_1;CHL;SC;N;NOT;;N;1;2
03;222222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;;CLP;7347500.00000;USD;10000.00000;;;;USD/CLP;734.75000;-1.7500000000;0.00000;0.00000
05;222222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;1;R;2021-10-28;7347500000.00000;C
05;222222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;2;E;2021-10-28;10000000.00000;C
01;222222222;Cont_2;2021-07-09T12:00:00;0;;REL;;;;;;;;;;;;;;;;
01;222222222;Cont_3;2021-08-09T12:00:00;0;Y;RVI;1234cod LEI Bco C 899;333333333;;Banco C;CHL;;;;;222222222;1234cod LEI Bco B 899;Banco B;;;OTC;;
02;222222222;Cont_3;2021-08-09T12:00:00;0;FWD;;;;EF;;2021-08-09;;2023-02-13;2023-02-13;;;0.00000;0.00000;NEG;CCGGCont_3;CHL;SC;N;NOT;;N;1;0
03;222222222;Cont_3;2021-08-09T12:00:00;0;;CLP;7932600000.00000;USD;10000000.00000;;;;USD/CLP;793.26000;-4.2600000000;0.00000;0.00000
08;222222222;Cont_3;2021-08-09T12:00:00;0;M;CLP;-191067879.00000;0.0000000000;0.0000000000;0.0000000000;0.0000000000;0.0000000000;353606.00000;0.00000;0.00000
01;222222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;Y;RNU;1234cod LEI Bco C 899;333333333;;Banco C;CHL;;;;;222222222;1234cod LEI Bco B 899;Banco B;;;OTC;;
02;222222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;FWD;;;;EF;;2021-07-09;;2021-10-07;2021-10-07;;;0.00000;0.00000;NEG;CCGG3005854;CHL;SC;N;NOT;;N;1;2
03;222222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;;CLP;7487100.00000;USD;10000.00000;;;;USD/CLP;748.71000;-1.7100000000;0.00000;0.00000
05;222222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;2;E;2021-10-07;10000000.00000;C
```

La carga del archivo .CSV de rectificación se realiza de la misma manera que se suben los archivos de información mensual, accediendo al menú carga de información / archivos masivos en el sistema

Luego de haber sido cargado el archivo .CSV, se debe ingresar al monitor y seleccionar el tipo de subyacente que está realizando la corrección para que se despliegue la información cargada

En esta sección debe revisar que tanto las columnas ***Carga*** y ***Validación*** no muestren errores, para luego proceder a realizar el envío (activar botón ***Enviar***)



Tras lo cual culminará el proceso de reporte de rectificación a los reportes mensuales.

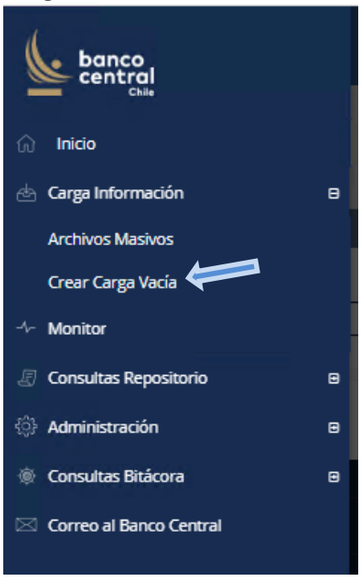
ANEXO 4: INSTRUCTIVO PARA LA CARGA DE INFORMACIÓN MENSUAL MEDIANTE LA FUNCIONALIDAD DE AUTOCOMPLETADO DE CAMPOS

Resumen

Este documento tiene por objetivo informar a los Participantes sobre la disponibilidad y uso de la funcionalidad de autocompletado de campos, una forma alternativa a la carga masiva de información vía archivo CSV, la cual consiste en un formulario de datos dentro aplicación web del SIID-TR.
El propósito de esta nueva opción de carga es facilitar la generación y el envío oportuno de los reportes mensuales requeridos en los diferentes Sistemas o subyacentes del SIID-TR (monedas-MFX, tasas de interés-MIR y renta fija-MIF), diseñado especialmente para aquellos Participantes que mantienen un número limitado de operaciones en cartera vigente y no disponen soluciones propias para la generación automática de sus reportes mensuales bajo el formato requerido por el SIID-TR.

1. Carga inicial de la información

Para realizar la carga de reportes mensuales, el usuario reportante debe ingresar al sistema, menú principal, y desplegar la opción Carga Información. En este ítem, se debe seleccionar la opción “Crear Carga Vacía”, la cual da acceso al módulo de carga mediante el formulario (autocompletado):



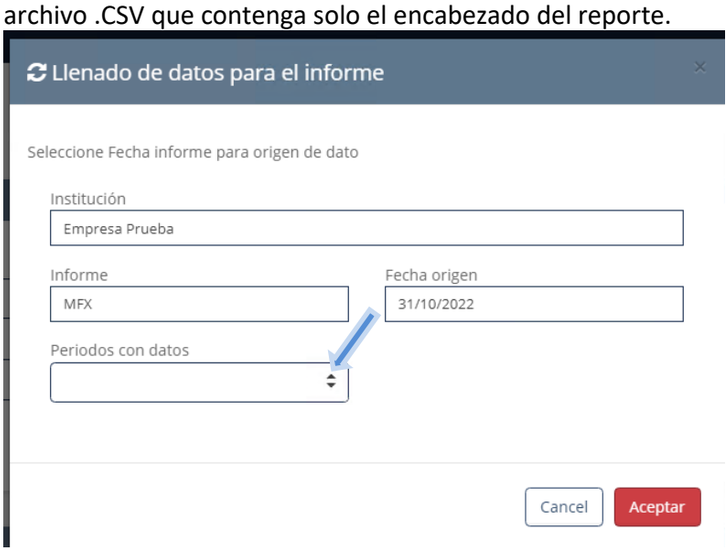
Al marcar esta opción, se desplegará una pantalla en la que se deben completar los campos de identificación del reporte que se desea ingresar, según se muestra en la imagen adjunta. Finalmente, pulsar el botón:

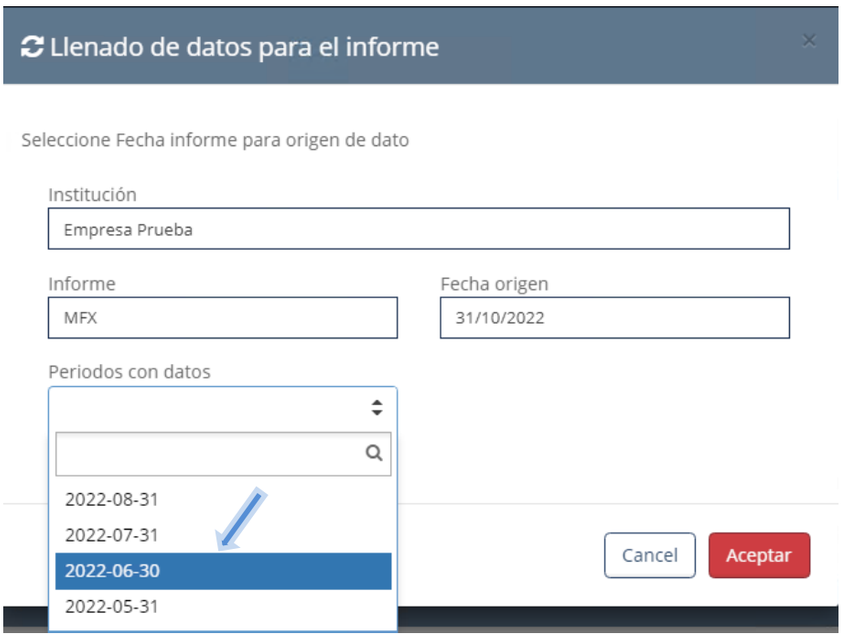
Generar Carga Vacía

A continuación, En la pantalla del Monitor, columna Carga, aparecerá el siguiente ícono:

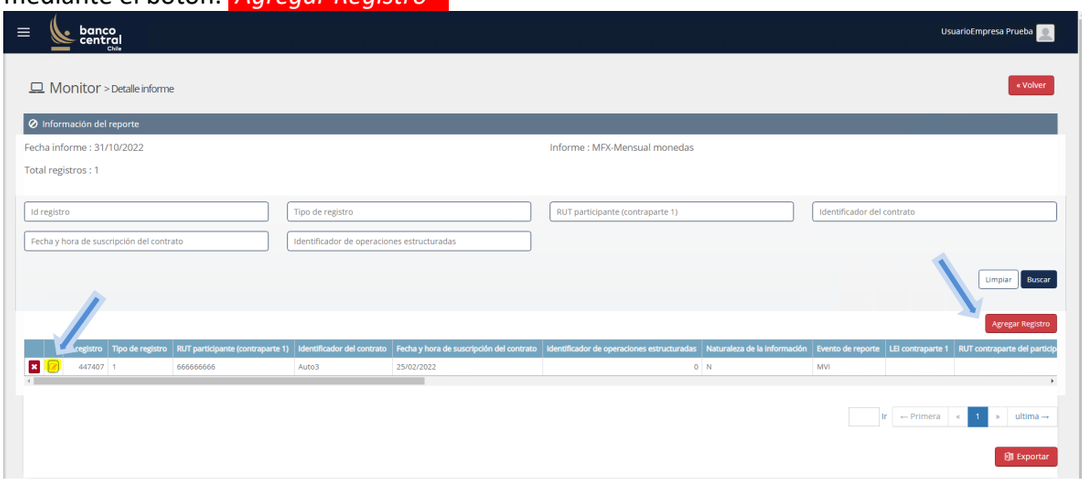
Luego se presenta una nueva pantalla donde el informante debe seleccionar en el campo ***Periodos con datos*** el mes sobre el cual va a completar la información de los contratos vigentes que haya enviado previamente al sistema. En caso de que no se hayan enviado reportes previos, por ser la primera vez

que se realiza el reporte, se debe realizar una carga vacía para el mes de referencia, es decir subir un archivo .CSV que contenga solo el encabezado del reporte.

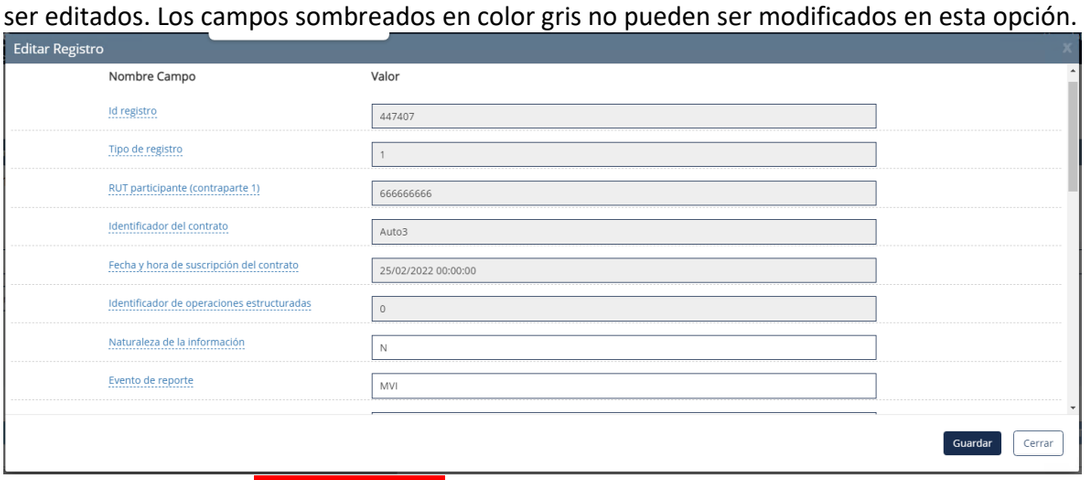




Luego de haber seleccionado el mes a copiar, este reporte se presenta en el Monitor, donde es posible realizar la edición de cada uno de los registros cargados (icono), así como crear nuevos registros mediante el botón: *Agregar Registro*



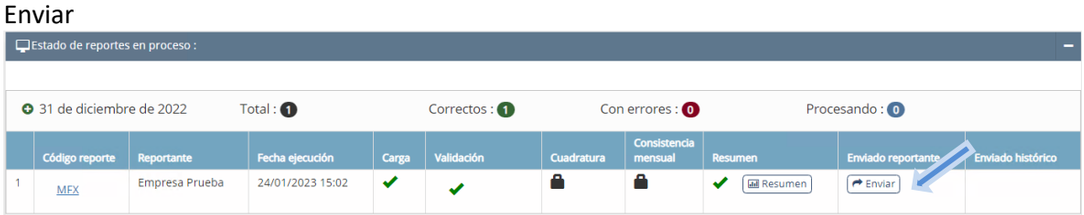
El botón de edición lleva a una nueva pantalla en la que aparecen los contratos con sus valores para ser editados. Los campos sombreados en color gris no pueden ser modificados en esta opción.



Por su parte, el botón *Agregar Registro* despliega un formulario vacío a ser completado en su totalidad.

Una vez completado el registro de las operaciones a reportar, en el monitor se presentará el icono: Procesar en la columna de Validación, el cual debe ser pulsado para iniciarán el procesamiento de la carga y validaciones del reporte.

Sí el reporte no posee errores de carga y validación, es posible finalizar el envío marcando el botón Enviar

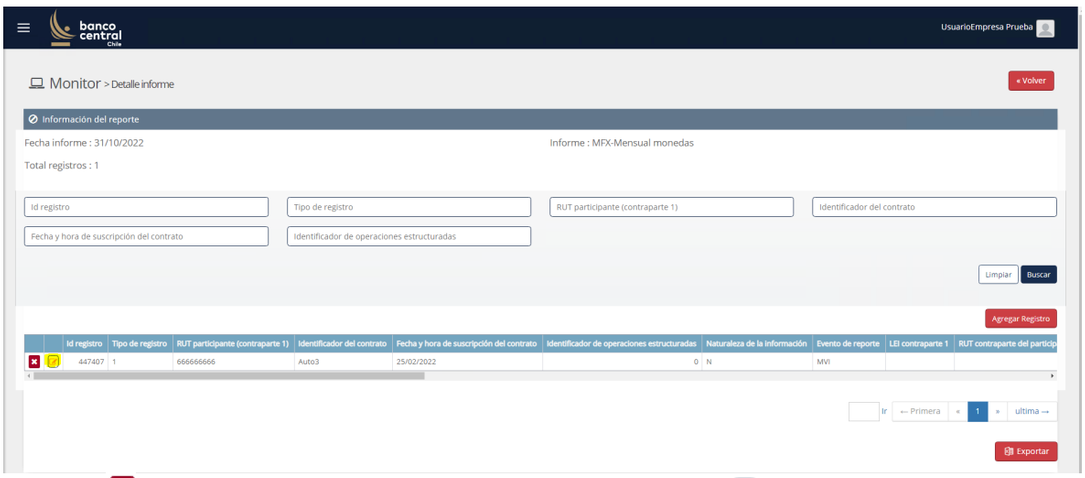


En caso de presentar errores que imposibiliten el envío, estos deben ser corregidos editando la información de los registros correspondientes.

2. Edición de registros

Con independencia del método de carga que se haya empleado para subir los reportes al SIID-TR (Carga masiva o Carga con autocompletado), es posible editar los reportes directamente en el sistema las veces que sea necesario, siempre que la misma no haya sido enviada, es decir que no se haya activado el botón Enviar. Para realizar esto, debe ingresar al monitor del SIID-TR y hacer clic sobre el correspondiente código de tres letras que aparece en la columna ***Código reporte***

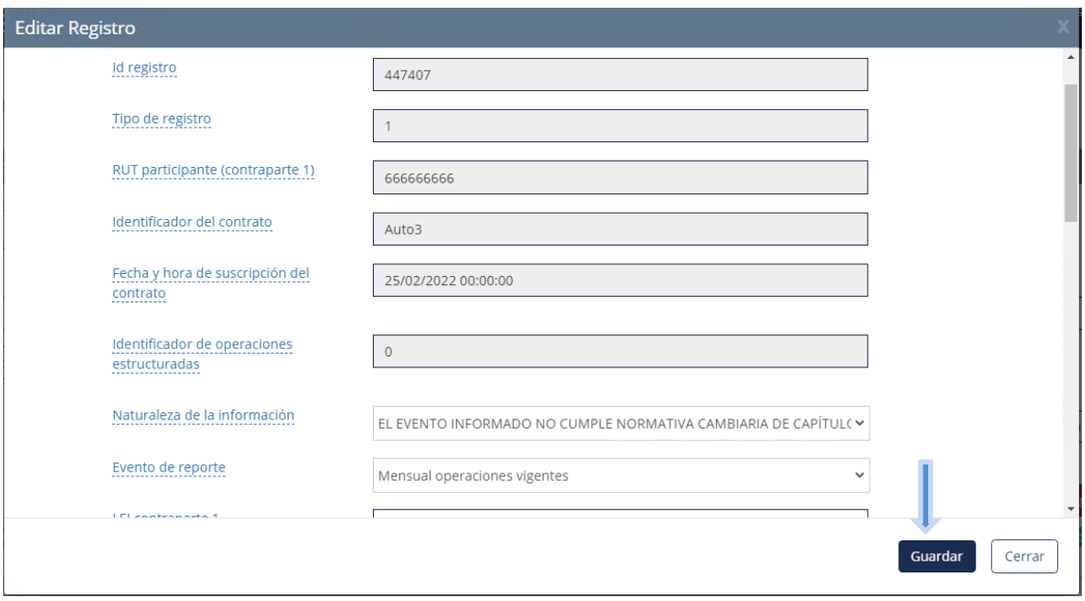
Esto desplegará la pantalla siguiente, donde aparece el resumen de las secciones del informe. Con el botón Ver detalle seleccionado, se mostrarán los registros que fueron cargados en cada una de las secciones.



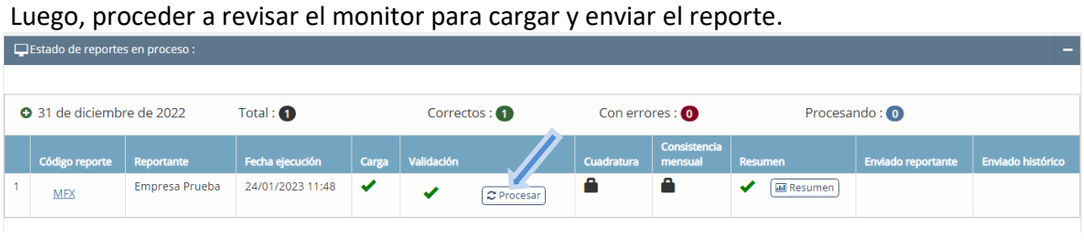
El botón permite eliminar el registro mientras que el botón despliega el formulario de edición, sobre el cual se pueden realizar las correcciones a que hubiere lugar.

Es de hacer notar que, los campos que están vinculados a las tablas del RO aparecerán con sus respectivos valores precargados, y se deberá seleccionar la opción que corresponda de la lista que se despliega. Por su parte, los campos que permiten valores nulos o vacíos y los que no están vinculados a tablas del RO, permitirán el ingreso de valores escritos por el usuario.

Una vez realizada la actualización respectiva, se deberán guardar los cambios realizados.

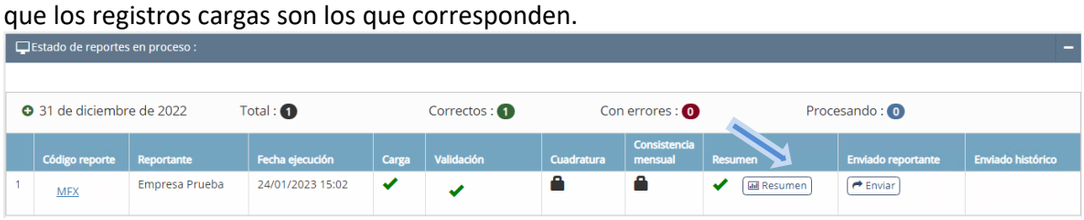


Luego, proceder a revisar el monitor para cargar y enviar el reporte.



Se recomienda revisar el resumen del reporte antes de proceder con el envío de este, para verificar

que los registros cargas son los que corresponden.



Finalmente, se debe marcar el botón Enviar, el que da por finalizado la entrega de información al SIID-TR.