

CARTA CIRCULAR

| | |
|--|--------|
| Bancos | N° 758 |
| Filiales bancarias comprendidas en el art. 70 letra a) de la LGB | N° 18 |
| Entidades MCF no bancarias | N° 38 |
| Otras entidades fiscalizadas CMF | N° 19 |
| Otros domiciliados o residentes | N° 26 |
| Agentes Autorizados Cap. III.D.3 CNF | N° 16 |

- ANT.: 1. Acuerdo N° 2617-04-240125, que modificó el Capítulo III.D.3 del Compendio de Normas Financieras en materia de derivados sobre renta variable y materias primas.
2. Cartas Circulares de 12 de marzo de 2020, 29 de marzo de 2021, 24 de septiembre de 2021, 11 de agosto y 6 de noviembre de 2023, y de 2 de mayo de 2024, que informan y actualizan las Especificaciones Técnicas y Tablas relativas al RO-SIID.

MAT.: Actualización de Tablas relativas al Reglamento Operativo del Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (RO-SIID).

Santiago, 23 de diciembre de 2025

Señor Gerente:

Adjunto a la presente sírvase encontrar una actualización del documento denominado “Tablas relativas al Reglamento Operativo del Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados (RO-SIID)”, que proporciona las tablas de códigos que deben considerarse en la elaboración de los reportes 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.

Esta nueva versión incorpora modificaciones a la Tabla N° 9 de Tipos de Tasa de Interés.

La actualización regirá a contar del 1° de enero de 2026 para las operaciones efectuadas a contar de esa fecha.

Saluda atentamente a usted,



JOSÉ MIGUEL VILLENA MARTÍNEZ
Gerente de Información Estadística

Incl.: Lo citado.



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. |
| Versión 1.5 | 02-05-2024 | Se actualiza documento conforme a la modificación del RO-SIID, Circular N° 3013-940, para incorporar los subyacentes de renta variable y materias primas. Ajustes rigen a contar del 1 de enero de 2026. |
| Versión 1.6 | 02-01-2026 | Se modifican las tablas N° 9 Tipo de tasas de interés. Ajustes rigen a contar del 1 de enero de 2026. |

Contenido

| | | |
|-------|---|-----|
| I. | INTRODUCCIÓN..... | 5 |
| II. | FORMATO, NOMBRE DE ARCHIVOS Y <i>HEADER</i> | 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), ADMINSTRADORAS GENERALES DE FONDOS (AGFs) Y REPORTANTES INDIRECTOS QUE INFORMAN A NOMBRE DE OTRA ENTIDAD. | 10 |
| | ANEXOS..... | 11 |
| | ANEXO 1: DETALLE DE TABLAS Y CÓDIGOS DEL SIID-TR..... | 11 |
| | Tabla 1: Naturaleza de la Información..... | 12 |
| | Tabla 2: Eventos de Reporte | 12 |
| | Tabla 3: Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija / Variable Subyacente..... | 12 |
| | Tabla 4: Instrumentos..... | 13 |
| | Tabla 5: Clase de Opción..... | 13 |
| | Tabla 6: Tipo de Posición | 13 |
| | Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente..... | 13 |
| | Tabla 8: Modalidad de Liquidación..... | 13 |
| | Tabla 9: Tipo de Tasa de Interés..... | 14 |
| | Tabla 10: Objetivo de la Operación | 15 |
| | Tabla 11: Convenio Marco..... | 16 |
| | Tabla 12: Garantías..... | 16 |
| | Tabla 13: Cláusula de <i>Recouping</i> | 16 |
| | Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado | 16 |
| | Tabla 15: Compresión de Cartera o <i>Recouping</i> | 17 |
| | Tabla 16: Tipo de Activos en Garantía | 17 |
| | Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado | 17 |
| | Tabla 18: Método de Valorización..... | 17 |
| | Tabla 19: Materias Primas..... | 18 |
| | Tabla 20: Unidad de Medida del Volumen Pactado | 18 |
| | Tabla 21: Índice de Referencia de la Materia Prima | 19 |
| | ANEXO 2.A: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE MONEDAS | 20 |
| | ANEXO 2.B: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE TASAS DE INTERÉS | 43 |
| | ANEXO 2.C: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA..... | 68 |
| | ANEXO 2.D: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE INSTRUMENTOS DE RENTA VARIABLE | 86 |
| | ANEXO 2.E: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE MATERIAS PRIMAS | 104 |
| | ANEXO 3: INSTRUCTIVO PARA MODIFICACIÓN DE REPORTES MENSUALES | 127 |
| | ANEXO 4: INSTRUCTIVO PARA LA CARGA DE INFORMACIÓN MENSUAL MEDIANTE LA FUNCIONALIDAD DE AUTOCOMPLETADO DE CAMPOS | 131 |

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 UF-CLP), tasas de interés, instrumentos de renta fija, instrumentos de renta variable y materias primas (en el caso de estos dos últimos subyacentes, a contar del 1 de enero de 2026). 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:

XXXXXXXXXCCCAAAMMDD

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.

AAAMMDD 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 |
| DCM | Diario sobre materias primas |
| MCM | Mensual sobre materias primas |
| MEQ | Mensual sobre instrumentos de renta variable |
| CFX | Corrección mensual sobre monedas |
| CIR | Corrección mensual sobre tasas de interés |
| CFI | Corrección mensual sobre renta fija |
| CEQ | Corrección mensual sobre renta variable |
| CCM | Corrección mensual sobre materias primas |

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 sus respectivos Sistemas o subyacentes, 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 | | | |
|---------------------------|--------|----------------------|------------------------|--------|---------|---------|
| Sección Normativa | Nombre | Sistema o subyacente | Tipo de registro | Diario | Mensual | |
| | | | | | Vigente | Vencido |
| 1.A: Información general | | FX-IR-FI-EQ-CM | 01 | | | |
| | | FX-IR-FI-EQ-CM | 02 | | | |
| | | FX-IR-FI-EQ-CM | 03 | | | |
| 1.B: Calendario de flujos | | FX-IR | 04 | | | |
| 2: Pagos del periodo | | FX-IR-FI-EQ-CM | 05 | | | |
| 3: Garantías | | FX-IR-FI-EQ-CM | 06 | | | |
| | | FX-IR-FI-EQ-CM | 07 | | | |
| 4: Valor de mercado | | FX-IR-FI-EQ-CM | 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.

EQ: Requerimiento del Sistema de instrumentos de renta variable (solo reportes mensuales)

CM: Requerimiento del Sistema de materias primas

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, instrumentos de renta fija, de renta variable y materias primas), 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 <i>offshore</i> del Yuan considerar el código CNH. | CLP |
| Países | Norma ISO 3166-1, alpha -3 | CHL |
| Plataforma de negociación | MIC “ <i>Market Identifier Code</i> ” 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, 2.C, 2.D y 2.E, se detalla el formato de cada uno de los campos relevantes para cada uno de los Sistemas del SIID.

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 recouping | 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 <i>fixing</i> 2 | No aplica |
| Convención tipo de cambio | USD/CLP |
| Precio pactado a futuro (tipo cambio futuro) | 750 |
| Puntos forward | -5 |
| Precio barrera de entrada (<i>Knock-in</i>) | No aplica |
| Precio barrera de salida (<i>Knock-out</i>) | No aplica |
| Número total del flujo | 2 |

Calendario

| | |
|--|------------|
| Número del flujo | 1 |
| Tipo de flujo | 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 <i>fixing</i> para tasa de interés | 2022-01-14 |
| Fecha de inicio del flujo | 2021-01-18 |
| Fecha de término del flujo | 2022-01-17 |
| Monto nocional aplicable al flujo | 1000000 |
| Monto flujo como intercambio del capital | 500000 |
| Moneda del monto como intercambio de capital | USD |
| Número del flujo | 1 |
| Tipo de flujo | 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 <i>fixing</i> para tasa de interés | 2022-01-14 |
| Fecha de inicio del flujo | 2021-01-18 |
| Fecha de término del flujo | 2022-01-17 |
| Monto nocional aplicable al flujo | 750000000 |
| Monto flujo como intercambio del capital | 375000000 |
| Moneda del monto como intercambio de capital | CLP |
| Número del flujo | 2 |
| Tipo de flujo | 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 <i>fixing</i> para tasa de interés | 2023-01-13 |
| Fecha de inicio del flujo | 2022-01-17 |
| Fecha de término del flujo | 2023-01-16 |
| Monto nocional aplicable al flujo | 500000 |
| Monto flujo como intercambio del capital | 500000 |
| Moneda del monto como intercambio de capital | USD |
| Número del flujo | 2 |
| Tipo de flujo | 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 <i>fixing</i> para tasa de interés | 2023-01-13 |
| Fecha de inicio del flujo | 2022-01-17 |
| Fecha de término del flujo | 2023-01-16 |
| Monto nocional aplicable al flujo | 375000000 |
| Monto flujo 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;76317
8897;213800FQ9YXIEP9GZG11;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG
11;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), ADMINISTRADORAS 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;ld_000126798;2020-10-
01T10:35:47;0;Y;MVI;;500000007;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;CHL;;;;;763178897;213800FQ9YXIEP
9GZG11;Agente de cálculo;;;OTC;;
1;620000000;ld_000126472;2020-10-
02T09:15:04;0;Y;MVI;;500000007;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;CHL;;;;;763178897;213800FQ9YXIEP
9GZG11;Agente de cálculo;;;OTC;;

```

1;630000009;ld_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;Y;MVI;;500000007;213800FQ9YXIEP9GZG11;ABCD;CHL;;;;;763178897;213800FQ9YXIEP9GZG11;Agente de cálculo;;;OTC;;

2;610000002;ld_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;ld_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;ld_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;ld_000126798;2020-10-01T10:35:47;0;;USD;2000000;CLP;1516000000;;;;;USD/CLP;758;-1.57;;

3;620000000;ld_000126472;2020-10-02T09:15:04;0;;USD;1000000;CLP;747320000;;;;;USD/CLP;747.32;3.67;;

3;630000009;ld_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;;USD;4000000;CLP;2930680000;;;;;USD/CLP;732.67;3.67;;

6;630000009;ld_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;E;CLP;Portafolio_Id_1234;500000;467903.274

7;630000009;ld_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;E;Portafolio_Id_1234;BBCH;55

7;630000009;ld_000127541;2020-10-05T13:43:17;0;E;Portafolio_Id_1234;BTGR;45

8;610000002;ld_000126798;2020-10-01T10:35:47;0;M;USD;147984.2365;;;;;24560;;5650

8;620000000;ld_000126472;2020-10-02T09:15:04;0;M;USD;67894.382;;;;;24560;;5650

8;630000009;ld_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 o de Renta Variable 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 <i>Recouping</i> |
| Tabla 14: Cláusula de Término Anticipado |
| Tabla 15: Compresión de Cartera o <i>Recouping</i> |
| Tabla 16: Tipos de Activos en Garantía |
| Tabla 17: Tipo de Pago Efectuado |
| Tabla 18: Método de Valorización |
| Tabla 19: Materias Primas |
| Tabla 20: Unidad de Medida del Volumen Pactado |
| Tabla 21: Índice de Referencia de la Materia Prima |

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 <i>recouponing</i> | 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 / Renta Variable Subyacente

| Descripción | Código |
|---|--------|
| <i>International Securities Identification Number (ISIN)</i> | ISI |
| Nemotécnico | NEM |
| <i>Alternative Instrument Identifier (AII)</i> | AII |
| <i>Committee on Uniform Securities Identification (CUSIP)</i> | CUS |
| <i>Stock Exchange Daily Official List (SEDOL)</i> | SED |
| <i>Financial Instrument Global Identifier (FIGI)</i> | FIG |
| Otro Identificador distinto de los anteriores | OTR |

Tabla 4: Instrumentos

| Descripción | Subsistema al que aplica | Código |
|---------------------------------|---|--------|
| <i>Cross Currency Swap</i> | I (Monedas) | CCS |
| <i>Forward Observado</i> | I (Monedas) | FOB |
| <i>FX Swap</i> | I (Monedas) | FXS |
| Futuro | I, II, III, IV y V (Monedas, Tasas de Interés, Renta fija, Renta variable y Materias primas, respectivamente) | FUT |
| <i>Forward</i> | I, II, III, IV y V (Monedas, Tasas de Interés, Renta fija, Renta variable y Materias primas, respectivamente) | FWD |
| <i>Swaption</i> | I y II (Monedas y Tasas de Interés, respectivamente) | STN |
| Opción <i>Call</i> | I, IV y V (Monedas, Renta variable y Materias primas, respectivamente) | CAL |
| Opción <i>Put</i> | I, IV y V (Monedas, Renta variable y Materias primas, respectivamente) | PUT |
| Opción <i>Cap</i> | II y III (Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente) | CAP |
| Opción <i>Floor</i> | II y III (Tasas de Interés y Renta Fija, respectivamente) | FLR |
| <i>Interest Rate Swap</i> | II (Tasa de Interés) | SWP |
| Otro distinto de los anteriores | I, II, III, IV y V (Monedas, Tasas de Interés, Renta fija, Renta variable y Materias primas, 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 | BYER |
| Vendedora | SLLR |

Tabla 7: Opciones - Instrumento Subyacente

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

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 |

| Descripción | Código |
|--|---------|
| TADO a 360 días (Tasa de interés promedio ponderada de depósitos a plazo en Dólares de los EE.UU. –ABIF/GRSS–) | TADO12M |
| Estados Unidos de América | |
| <i>Prime Rate</i> | PRIMERT |
| <i>SOFR (Secured Overnight Financing Rate)</i> | 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 |
| <i>EFFR (Federal Funds Effective Rate)</i> | FEDFUND |
| <i>OBFR (United States Overnight Bank Funding Rate)</i> | 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 | |
| €STER (<i>Euro Short-Term Rate</i>) | 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 |
| <i>EONIA (Euro Overnight Index Average)</i> | EONIAON |
| Inglaterra | |
| <i>SONIA (Sterling Overnight Interbank Average Rate)</i> | SONIAON |
| México | |
| Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio a 1 día | TIIE0ON |
| 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 |
| Suiza | |
| <i>SARON (Swiss Average Rate Overnight)</i> | SWAVRON |
| Japón | |
| <i>TONA (Tokyo Overnight Average Rate)</i> | 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 *Recouping*

| Descripción | Código |
|----------------------------------|--------|
| Con cláusula de <i>Recouping</i> | Y |
| Sin cláusula de <i>Recouping</i> | 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 *Recouping*

| Descripción | Código |
|---|--------|
| Contrato es resultado de una compresión de cartera o un <i>recouping</i> | Y |
| Contrato no es resultado de una compresión de cartera o un <i>recouping</i> | 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 | FMMM |
| 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

| Descripción | Código |
|---|--------|
| 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 <i>recouping</i> | R |
| Otro tipo de pago distinto de los anteriores | O |

Tabla 18: Método de Valorización

| Descripción | Código |
|--|--------|
| Valor razonable a precios de mercado (<i>mark-to-market</i>) | M |

| | |
|---|---|
| Valor razonable utilizando modelos (<i>mark-to-model</i>) | O |
| Valor razonable calculado por Contraparte Central | C |
| Otro método de valoración distinto de los anteriores | T |

Tabla 19: Materias Primas

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

Tabla 20: Unidad de Medida del Volumen Pactado

| Descripción | Código |
|-----------------|--------|
| Barril | BRRL |
| Galón Americano | GALA |
| Galón Inglés | GALI |
| Kilo | KILO |
| Libra | LIBR |

| | |
|---|------|
| Onza troy | ONZT |
| Toneladas métricas | TONM |
| Otra unidad de medida distinta a las anteriores | OTRO |

Tabla 21: Índice de Referencia de la Materia Prima

| Descripción | Código |
|---|--------|
| <i>Euronext</i> | EUNXT |
| <i>Dated Brent</i> | DTBRT |
| <i>Intercontinental Exchange</i> | ICEXG |
| <i>International Petroleum Exchange</i> | IPEXG |
| <i>London Metal Exchange</i> | LMEXG |
| <i>Marketwire</i> | MKTWR |
| <i>New York Board of Trade</i> | NYBOT |
| <i>New York Mercantile Exchange</i> | NYMEX |
| <i>Oil Price Information Service (OPIS)</i> | OPI SX |
| Otro índice de referencia distinto a los anteriores | OTROS |

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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 |

| | | | | | | | |
|--|--|--|---|-------------------|--|---------|----|
| | | | 2 | Evento de Reporte | <p>Código que identifica el tipo de registro que será informado o reportado, según la Tabla Eventos de Reporte. Este podrá corresponder a:</p> <p>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.</p> <p>2.2 Modificación Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante. 2.2.1 Recouping: 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.</p> <p>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).</p> | Char(3) | No |
|--|--|--|---|-------------------|--|---------|----|

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|--|
| | | | | | <p>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.</p> <p>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.</p> <p>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.</p> | | |
| | | | 4 | LEI contraparte 1 | Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|--|--------------|---|
| | | | 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>), 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>), 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|------------------------------|---|--------------|---|
| | | | 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. |
| | | | 17 | LEI Cedente o Cesionario | Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>), 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 (<i>Market Identifier Code</i>) 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 (<i>Broker</i>) que actuó como intermediario en el cierre de la operación. | Varchar(9) | Sí, cuando la información no aplica. |
| | | | 58 | LEI Intermediario | Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>), si lo tuviere, del <i>Broker</i> 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|---|--------------|---|
| | | | 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. |
| | | | 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 <i>fixing</i> 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 <i>fixing</i> . 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|--|--------------|--|
| | | | 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 |
| | | | 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|--|--------------|---|
| | | | 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 |
| | | | 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 notional. 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 <i>swaption</i>). 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|------------------------------------|---|--------------|--|
| | | | 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 |
| | | | 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 <i>fixing</i> 2 | Fecha final del período a considerar en el <i>fixing</i> 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 <i>fixing</i> . |
| | | | 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--|
| | | | 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. |
| | | | 46 | Precio barrera de entrada (<i>Knock-in</i>) | 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 " <i>up-and-in</i> " o " <i>down-and-in</i> ". 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 (<i>Knock-out</i>) | 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 " <i>up-and-out</i> " o " <i>down-and-out</i> ". 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 |
| | | | 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 flujo es variable. |
| | | | 64/74 | Fecha de <i>fixing</i> 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------|--|--------------|---------------------|
| | | | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | 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 | 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? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--|
| | | | | | campo no deberá ser completado. | | |
| | | | 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 <i>recouping</i> . 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 (" <i>haircut</i> "). 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|---|--------------|---------------------|
| | | | 89,93 | Tipo activo en garantía | Tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, 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 |
| | | | 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 |

| 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 (<i>mark-to-market</i>), modelos de cálculo (<i>mark-to-model</i>), 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 | <p>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.</p> <p>En el caso de operaciones estructuradas, se deberá indicar el valor de mercado de cada uno de los instrumentos que la componen.</p> <p>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.</p> | 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: $\Delta = \partial V / \partial S$). | 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: $\Gamma = \partial \Delta / \partial S = \partial^2 V / \partial S^2$). | 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: $v = \partial V / \partial \sigma$). | Num(4,10) | Sí, cuando la información no aplica. |
| | | | 105 | Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte (<i>Credit value adjustment</i>) | Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2. <p>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.</p> | Num(15,5) | Sí, cuando la información no aplica. |
| | | | 106 | Ajuste a la valorización por <i>BID-OFFER Spread</i> | Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por <i>BID-OFFER Spread</i> de la cartera de contratos de derivados de monedas, para la Contraparte 1. <p>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.</p> | 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. <p>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.</p> | 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|------------------------------|--|--------------|---------------------|
| | | | 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 |
| | | | 2 | Evento de reporte | <p>Código que identifica el tipo de registro que será informado o reportado, según la Tabla Eventos de Reporte. Este podrá corresponder a:</p> <p>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.</p> <p>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.</p> | Char(3) | No |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--------------|---|--------------|---------------------|
| | | | | | <p>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.</p> | | |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|--|
| | | | | | <p>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.</p> <p>2.3.2 Cesión: Transferencia a un tercero de un Contrato previamente reportado por el Participante (cedente).</p> <p>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.</p> <p>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.</p> <p>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.</p> | | |
| | | | 4 | LEI Contraparte 1 | Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|--|--------------|---|
| | | | 6 | LEI Contraparte 2 | Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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 |
| | | | 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>), 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|---|
| | | | 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>), 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 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>), 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------|--|--------------|--------------------------------------|
| | | | 54 | Plataforma de Negociación | Código de la Plataforma de Negociación en la cual fue pactado el contrato de derivado, según código MIC (<i>Market Identifier Code</i>) 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>), 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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(9) | 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|------------------------------------|--|--------------|--|
| | | | 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. |
| | | | 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 <i>fixing</i> 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|--|--------------|--|
| | | | 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. |
| | | | 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---|
| | | | 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 |
| | | | 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 <i>Recouponing</i> | 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 notional. En el caso de operaciones que comprende más de un intercambio a futuro o corresponden a instrumentos <i>Interest Rate Swap</i> , 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. | 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 nacional | Código de la moneda en la que esta expresado el monto notional sobre el cual se calculan los intereses a intercambiar, 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? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|---|
| | | | 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 <i>Interest Rate Swap</i> . | Num(15,5) | Si, solo si instrumento es SWP o el N° de intercambios o flujos es mayor a 1. |
| | | | 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 contrario 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 contrario 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|---|--------------|---|
| | | | 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) | Sí, 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. |
| | | | 44 | Precio barrera de entrada (<i>Knock-in</i>) | 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 (<i>Knock-out</i>) | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 componen la 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. | Varchar(52) | No |
| | | Sí | 31 | Fecha y hora de suscripción del Contrato | 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). | 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|---|
| | | | 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. |
| | | | 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 <i>fixing</i> 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | 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 | 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|------------------------|--|--------------|---------------------|
| | | | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | 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 | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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. | 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 | Varchar(52) | No |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|---|--------------|---------------------|
| | | | | | Ley N° 20.345, este campo no deberá ser completado. | | |
| | | | 84, 88 | Tipo activo en garantía | Tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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), | 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 (<i>mark-to-market</i>), modelos de cálculo (<i>mark-to-model</i>), 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|--|--------------|--------------------------------------|
| | | | 93 | Valor de mercado | <p>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.</p> <p>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.</p> | Num(15,5) | No |
| | | | 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: $\Gamma = \partial \Delta / \partial S = \partial^2 V / \partial S^2$). | 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 (<i>Credit value adjustment</i>) | <p>Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por riesgo de crédito que asume la Contraparte 1 respecto de la Contraparte 2.</p> <p>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.</p> | Num(15,5) | Sí, cuando la información no aplica. |
| | | | 102 | Ajuste a la valorización por <i>BID-OFFER Spread</i> | <p>Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por <i>BID-OFFER Spread</i> de la cartera de contratos de derivados de tasas de interés, para la Contraparte 1.</p> <p>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.</p> | Num(15,5) | 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? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------|--|--------------|--------------------------------------|
| | | | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 |
| | | | 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 | <p>Código que identifica el tipo de registro que será informado o reportado, según la Tabla Eventos de Reporte. Este podrá corresponder a:</p> <p>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.</p> <p>2.2 Modificación Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante. 2.2.1 Recouping: 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.</p> <p>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.</p> | Char(3) | No |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---|
| | | | | | <p>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.</p> <p>2.3.2 Cesión: Transferencia a un tercero de un Contrato previamente reportado por el Participante (cedente).</p> <p>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.</p> <p>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.</p> <p>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.</p> | | |
| | | | 4 | LEI Contraparte 1 | Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|---|
| | | | 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. | 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>), 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|--|--------------|--|
| | | | 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 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 (<i>Broker</i>) 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--------------------------------------|--|--------------|---|
| | | | 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. |
| | | | 34 | Fecha <i>fixing</i> 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---|
| | | | 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 |
| | | | 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 Recouping | Indicar si la operación considera o no cláusula de Recouping en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de Recouping. | 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 <i>Recouping</i> | 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 Recouping. | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | 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 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 |
| | | | 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--------------------------|---|--------------|---------------------|
| | | | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|----------------|---|--------------|---------------------|
| | | | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 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 |
| | | | 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 <i>recouping</i> . 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|-------------------------------------|---|--------------|---|
| | | | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | Tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada 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? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|---|--------------|---------------------|
| | | | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 (<i>mark-to-market</i>), modelos de cálculo (<i>mark-to-model</i>), 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--------------------------------------|
| | | | 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: $\Gamma = \partial \Delta / \partial S = \partial^2 V / \partial S^2$). | Num(4,10) | Sí, cuando la información no aplica. |
| | | | 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: $v = \partial V / \partial \sigma$). | Num(4,10) | Sí, cuando la información no aplica. |
| | | | 77 | Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte (<i>Credit value adjustment</i>) | 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 2.D: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE INSTRUMENTOS DE RENTA VARIABLE

| 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 |
| | | | 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 | <p>Código que identifica el tipo de registro que será informado o reportado, según la Tabla Eventos de Reporte. Este podrá corresponder a:</p> <p>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.</p> <p>2.2 Modificación Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante. 2.2.1 Recouping: 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.</p> <p>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.</p> | Char(3) | No |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---|
| | | | | | <p>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.</p> <p>2.3.2 Cesión: Transferencia a un tercero de un Contrato previamente reportado por el Participante (cedente).</p> <p>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.</p> <p>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.</p> <p>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.</p> | | |
| | | | 4 | LEI Contraparte 1 | Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|---|
| | | | 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. | 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>), 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|--|--------------|--|
| | | | 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 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. |
| | | | 51 | 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 |
| | | | 52 | RUT Intermediario | RUT (Rol Único Tributario) del Intermediario (<i>Broker</i>) que actuó como intermediario en el cierre de la operación. | Varchar(9) | Sí, cuando la información no aplica. |
| | | | 53 | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | 34 | 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 |
| | | | 27 | 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 |
| | | | 28 | 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. |
| | | | 29 | 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. |
| | | | 30 | 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 |
| | | | 31 | 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--------------------------------------|--|--------------|--|
| | | | 35 | Fecha de inicio | Fecha en la cual comienzan a devengarse los intereses de la operación en favor de alguna de las contrapartes. | Date | No |
| | | | 36 | Fecha <i>fixing</i> 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 |
| | | | 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. |
| | | | 40 | 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 |
| | | | 41 | 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---|
| | | | 42 | 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. |
| | | | 43 | 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 |
| | | | 44 | 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 |
| | | | 45 | 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 |
| | | | 46 | 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 |
| | | | 47 | Cláusula de Recouping | Indicar si la operación considera o no cláusula de Recouping en el Contrato o en el Convenio Marco, según la Tabla Cláusula de Recouping. | Char(1) | No |
| | | | 48 | 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 |
| | | | 49 | 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. |
| | | | 50 | Compresión de cartera o <i>Recouping</i> | 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 Recouping. | 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 |
| | | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | 34 | 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, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile. | Datetime (largo 19) | No |
| | | | 32 | 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 |
| | | | 33 | Monto nocional | Se debe indicar el monto nocional de la operación. | Num(15,5) | No |
| | | | 20 | Tipo de Identificador del activo de renta variable subyacente | Tipo de identificador del activo de renta variable de acuerdo con lo indicado en la Tabla Tipo de Identificador del Activo de Renta Fija o Renta Variable | 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 Variable Subyacente". | Char(15) | No |
| | | | 23 | Precio Pactado a Futuro | Valor a futuro del activo de renta variable o índice. Para el caso de una opción, este campo corresponde al Precio Strike. | Num(15,5) | No |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--------------------------|---|--------------|---------------------|
| | | | 24 | Multiplicador del precio | Multiplicador sobre el precio del activo de renta variable que se transa en el contrato. Considerando que el precio de activo por el multiplicador refleja el valor del contrato. | Num(15,5) | No |
| | | | 25 | Cantidad pactada | Número de contratos derivados pactados sobre el activo de renta variable, acciones o índice accionario. | Num(5) | No |
| | | | 26 | Posición de la operación | Indicar si la Contraparte 1 asume la posición compradora o vendedora sobre el instrumento de renta variable, 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | 34 | 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, y tomando como referencia el horario de Santiago de Chile. | Datetime | No |
| | | | 54 | 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 |
| | | | 55 | 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 |
| | | | 56,57 | 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 |
| | | | 58 | Tipo de pago efectuado | Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado. | Char(1) | No |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|----------------|---|--------------|---------------------|
| | | | 59 | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 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 |
| | | | 60 | 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 | Char(3) | Sí, cuando no hay garantías a informar. |
| | | | 61, 65 | 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---|
| | | | 63, 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 <i>recouponing</i> . 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 |
| | | | 64, 68 | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 |
| | | | 61, 64 | 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 |
| | | | 61, 64 | Tipo activo en garantía | Tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada, 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? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|--|--------------|---------------------|
| | | | 62, 66 | Porcentaje tipo de activo en garantía | <p>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.</p> <p>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.</p> | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 |
| | | | 69 | Método de valorización | Indicar si la valorización fue realizada utilizando precios de mercado (<i>mark-to-market</i>), modelos de cálculo (<i>mark-to-model</i>), 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 |
| | | | 70 | Moneda de valorización | Código de la moneda en que se encuentre valorizada la operación, según norma ISO 4217. | Char(3) | No |
| | | | 71 | 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 |
| | | | 72 | 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--------------------------------------|
| | | | 73 | 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. |
| | | | 74 | 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: $\Gamma = \partial \Delta / \partial S = \partial^2 V / \partial S^2$). | Num(4,10) | Sí, cuando la información no aplica. |
| | | | 75 | 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. |
| | | | 78 | Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte (<i>Credit value adjustment</i>) | 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. |
| | | | 79 | 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. |
| | | | 80 | 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. |
| | | | 76 | 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 |
| | | | 77 | 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.E: DETALLE DE FORMATO DE CAMPOS SISTEMA DERIVADOS SOBRE MATERIAS PRIMAS

| 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 | 37 | 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|------------------------------|---|--------------|---------------------|
| | | | 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 |
| | | | 2 | Evento de reporte | <p>Código que identifica el tipo de registro que será informado o reportado, según la Tabla Eventos de Reporte. Este podrá corresponder a:</p> <p>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.</p> <p>2.2 Modificación Corresponde a modificaciones incorporadas a los Contratos reportadas previamente por el Participante. 2.2.1 Recouponsing: 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.</p> | Char(3) | No |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|--|
| | | | | | <p>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.</p> <p>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.</p> <p>2.3.2 Cesión: Transferencia a un tercero de un Contrato previamente reportado por el Participante (cedente).</p> <p>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.</p> <p>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.</p> <p>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.</p> | | |
| | | | 4 | LEI Contraparte 1 | Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>) que identifica a la Contraparte de la persona o entidad obligada a reportar, si lo tuviere. | Char(20) | No |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|---|
| | | | 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. | 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>), 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>) 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|--|--------------|---|
| | | | 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>), 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 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 (<i>Legal Entity Identifier</i>), 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. |
| | | | 59 | Plataforma de Negociación | Código de la Plataforma de Negociación en la cual fue pactado el contrato de derivado, según código MIC (<i>Market Identifier Code</i>) 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 |
| | | | 60 | 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|-------------------|---|--------------|--------------------------------------|
| | | | 61 | LEI Intermediario | Código LEI (<i>Legal Entity Identifier</i>), 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | 37 | 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(9) | 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--|
| | | | 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. |
| | | | 35 | 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 |
| | | | 36 | 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. |
| | | | 38 | Fecha de inicio | Fecha en la cual se comienza a calcular el precio de la operación en favor de alguna de las contrapartes. | Date | No |
| | | | 39 | Fecha de Fixing 1 para el índice de referencia por la compra de la materia prima. | <p>Fecha que se considera para el índice de referencia a pagar por la compra de la materia prima, según se estipule en el Contrato.</p> <p>Para instrumentos que consideran una única fecha para definir el valor del índice de referencia, se deberá informar en este campo dicha fecha.</p> <p>Para instrumentos que consideran un periodo de fechas para el fixing del índice de referencia, como, por ejemplo, el cálculo de un valor promedio se deberá informar en este campo la fecha de inicio del periodo de fechas a considerar en el fixing.</p> | Date | Sí, cuando el precio de compra no involucre un índice variable |
| | | | 40 | Fecha de Fixing 2 para el índice de referencia por la compra de la materia prima. | Fecha final del periodo a considerar en el fixing de una operación, para el índice de referencia a pagar por la compra de la materia prima, según se estipule en el Contrato. | Date | Sí, cuando el precio de compra no involucre un índice variable o tengo solo una fecha de fixing. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|--|
| | | | 41 | Fecha de Fixing 1 para el índice de referencia por la venta de la materia prima. | <p>Fecha que se considera para el índice de referencia a recibir por la venta de la materia prima, según se estipule en el Contrato.</p> <p>Para instrumentos que consideran una única fecha para definir el valor del índice de referencia, se deberá informar en este campo dicha fecha.</p> <p>Para instrumentos que consideran un periodo de fechas para el fixing del índice de referencia, como, por ejemplo, el cálculo de un valor promedio se deberá informar en este campo la fecha de inicio del periodo de fechas a considerar en el fixing.</p> | Date | Sí, cuando el precio de venta no involucre un índice variable |
| | | | 42 | Fecha de Fixing 2 para el índice de referencia por la venta de la materia prima. | Fecha final del período a considerar en el fixing de una operación, para el índice de referencia a recibir por la venta de la materia prima, según se estipule en el Contrato | Date | Sí, cuando el precio de venta no involucre un índice variable o tengo solo una fecha de fixing. |
| | | | 43 | 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 |
| | | | 44 | Fecha de pago de la operación | Fecha de la última liquidación de la operación. | Date | No |
| | | | 45 | 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. |
| | | | 46 | 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? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---|
| | | | 47 | 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. |
| | | | 48 | 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. |
| | | | 51 | 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 |
| | | | 52 | 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 |
| | | | 53 | 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 |
| | | | 54 | 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 |
| | | | 55 | 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 |
| | | | 56 | 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 |
| | | | 57 | 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|------------------------------------|
| | | | 58 | Compresión de cartera o <i>Recouponing</i> | 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 |
| | | | 62 | 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 | 37 | 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 |
| | | | 26 | Volumen notional pactado | Se debe indicar el volumen notional pactado de la operación, sobre el cual se calculan los pagos. | Num(15,5) | No |
| | | | 27 | Unidad de Medida del Volumen notional Pactado | Se debe indicar la unidad de medida en la que se mide el Volumen Notional Pactado sobre la materia prima según la Tabla Unidad de Medida del Volumen Pactado. | Char(5) | No |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--|
| | | | 25 | Materia prima | Tipo de materia prima a la que corresponda la operación informada según la Tabla Materias Primas | Char(5) | 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. |
| | | | 28 | Moneda del precio de la Materia Prima | Código de la moneda en la cual se pacta el precio de la materia prima, según norma ISO 4217. | Char(3) | No |
| | | | 29 | Precio fijo a pagar por la compra de la materia prima | Se debe indicar el precio pactado a pagar por cada unidad de la materia prima comprada por la Contraparte 1. | Num(15,5) | Sí, cuando el precio de compra no sea fijo |
| | | | 30 | Índice de referencia de compra de la materia prima | Se debe indicar el índice de referencia utilizado para definir el precio a pagar por la materia prima comprada, según la Tabla Índice de Referencia de Materia Primas. | Char(5) | Sí, cuando el precio de compra no sea sobre un índice variable |
| | | | 31 | Spread sobre índice de referencia por la compra de la materia prima | Spread sobre el índice de referencia a pagar por la compra de la materia prima. | Num(5,5) | Sí, cuando no exista un spread sobre el precio de compra |
| | | | 32 | Precio Fijo a Recibir por la Venta de la Materia Prima | Se debe indicar el precio pactado a recibir por cada unidad de la materia prima vendida por la Contraparte 1. | Num(15,5) | Sí, cuando el precio de venta no sea fijo |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|---|
| | | | 33 | Índice de Referencia por la Venta de la Materia Prima | Se debe indicar el índice de referencia utilizado para definir el precio a recibir por la materia prima vendida, según la Tabla Índice de referencia de la materia prima. | Char(5) | Sí, cuando el precio de venta no sea sobre un índice variable |
| | | | 34 | Spread sobre el Índice de Referencia por la Venta de la Materia Prima (<i>"diferencial base"</i>) | Spread sobre el índice de referencia a recibir por la venta de la materia prima. | Num(5,5) | Sí, cuando no exista un spread sobre el precio de venta |
| | | | 49 | Precio barrera de entrada (<i>Knock-in</i>) | 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. |
| | | | 50 | Precio barrera de salida (<i>Knock-out</i>) | 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? |
|-----------------------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|----------------|---------------------|
| 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | 37 | 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 |
| | | | 63 | 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 |
| | | | 64 | 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 |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------|--|--------------|---------------------|
| | | | 65, 66 | 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 |
| | | | 67 | Tipo de pago efectuado | Indicar la naturaleza del pago realizado, según la Tabla Tipo de Pago Efectuado. | Char(1) | No |
| | | | 68 | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | 37 | 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 |
| | | | | Tipo garantía (E: entregada, R: recibida) | Código del tipo de garantía que se está reportando. E: entregado - R: recibido | Char(1) | No |
| | | | 69 | 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? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|--|--|--------------|---|
| | | | 70, 71 | 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. |
| | | | 72, 76 | 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 recouping. 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. |
| | | | 73, 77 | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | 37 | 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 |
| | | | 70, 74 | 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? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------------|---|--------------|---------------------|
| | | | 71, 75 | Tipo activo en garantía | Tipo de activo(s) entregado/recibido(s) en garantía por la Contraparte 1 para caucionar la operación informada 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 |
| | | | 71, 75 | 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 (<i>Unique Transaction Identifier</i>), 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 | 37 | 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 |
| | | | 78 | Método de valorización | Indicar si la valorización fue realizada utilizando precios de mercado (<i>mark-to-market</i>), modelos de cálculo (<i>mark-to-model</i>), 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 |
| | | | 79 | Moneda de valorización | Código de la moneda en que se encuentre valorizada 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? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---|---|--------------|--------------------------------------|
| | | | 80 | 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 |
| | | | 81 | 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. |
| | | | 82 | 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. |
| | | | 83 | 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: $\Gamma = \partial \Delta / \partial S = \partial^2 V / \partial S^2$). | Num(4,10) | Sí, cuando la información no aplica. |
| | | | 84 | 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. |
| | | | 87 | Ajuste a la valorización por riesgo de crédito de la contraparte (<i>Credit value adjustment</i>) | 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. |
| | | | 88 | Ajuste a la valorización por <i>BID-OFFER Spread</i> | Indicar monto de ajuste al Valor de Mercado Neto por <i>BID-OFFER Spread</i> 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. |

| Sub-sección | Tipo de registro | Primary Key | N° Campo Sistema o Normativa | Nombre Campo | Descripción | Formato dato | ¿Puede venir vacío? |
|-------------|------------------|-------------|------------------------------|---------------------------------|--|--------------|--------------------------------------|
| | | | 89 | 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. |
| | | | 85 | 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 |
| | | | 86 | 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, renta fija, renta variable y materias primas); 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 | <i>(aplica al sistema N° 1: Monedas)</i> |
| 111111111 CIR AAAAMMDD | <i>(aplica al sistema N° 2: Tasa de interés)</i> |
| 111111111 CFI AAAAMMDD | <i>(aplica al sistema N° 3: Renta fija)</i> |
| 111111111 CEQ AAAAMMDD | <i>(aplica al sistema N° 4: Renta variable)</i> |
| 111111111 CCM AAAAMMDD | <i>(aplica al sistema N° 5: Materias primas)</i> |

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, CIR, CEQ O CCM: especifica el sistema de información o subyacente al que se refiere la corrección (Renta fija -CFI-, Monedas -CFX-, Tasa de interés -CIR-, Renta variable -CEQ- y Materias primas-CCM-)

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 <i>recouping</i> | 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 | <i>Nuevo</i> |
| Mensual rectificación operaciones vencidas | RVE | <i>Nuevo</i> |
| Mensual incorporación operaciones no informadas | RNU | <i>Nuevo</i> |
| Mensual anulación de operaciones informadas | REL | <i>Nuevo</i> |

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 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:

Rectificación de contrato vigente (RVI) y de 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 particular, debe corregir los montos informados en su contrato vigente de ID "Cont_3" y en su contrato vencido con ID "Cont_1". Se debe subir al sistema el archivo .CSV, siguiendo la estructura mostrada a continuación:

Para modificar el contrato vigente:

```
22222222CFX20220331
01;22222222;Cont_3;2021-08-09T12:00:00;0;Y;RVI;1234cod LEI Bco C 899;333333333;;Banco C;CHL;;;22222222;1234cod LEI Bco B 899;Banco B;;OTC;;
02;22222222;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;22222222;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;22222222;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:

```
22222222CFX20220331
01;22222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;Y;RVE;1234cod LEI Bco C 899;33333333;;Banco C;CHL;;;;22222222;1234cod LEI Bco B 899;Banco B;;;OTC;;
02;22222222;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;22222222;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;22222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;1;R;2021-10-28;7347500000.00000;C
05;22222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;2;E;2021-10-28;10000000.00000;C
```

Agregar contrato no enviado anteriormente:

Para agregar un contrato no informado previamente (ID “Cont_5”), se debe subir al sistema el archivo .CSV, siguiendo la estructura mostrada a continuación:

```
22222222CFX20220331
01;22222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;Y;RNU;1234cod LEI Bco C 899;33333333;;Banco C;CHL;;;;22222222;1234cod LEI Bco B 899;Banco B;;;OTC;;
02;22222222;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;22222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;CLP;7487100.00000;USD;10000.00000;;;USD/CLP;748.71000;-1.710000000;0.00000;0.00000
05;22222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;2;E;2021-10-07;10000000.00000;C
```

Eliminación de un contrato enviado previamente:

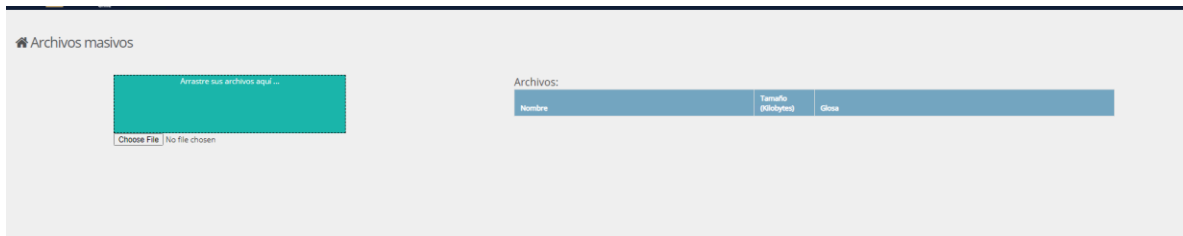
Para eliminar un contrato ya informado (ID “Cont_2”), se debe completar de la sección 01 la llave primaria (numero de la sección, Rut contraparte 1, ID del contrato, fecha y hora de suscripción e indicador de operaciones estructuradas) además del código del evento de reporte para eliminación (REL). El resto de los campos de la sección 01 deben enviarse vacíos. El reporte se verá de esta forma:

```
22222222CFX20220331
01;22222222;Cont_2;2021-07-09T12:00:00;0;;REL;,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,;
```

Cabe mencionar que, todas las correcciones referentes a un reporte mensual particular deberán ser incluidas en el mismo archivo .CSV, tal como se muestra en la siguiente imagen:

```
22222222CFX20220331
01;22222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;Y;RVE;1234cod LEI Bco C 899;33333333;;Banco C;CHL;;;;22222222;1234cod LEI Bco B 899;Banco B;;;OTC;;
02;22222222;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;22222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;CLP;7347500.00000;USD;10000.00000;;;USD/CLP;734.75000;-1.750000000;0.00000;0.00000
05;22222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;1;R;2021-10-28;7347500000.00000;C
05;22222222;Cont_1;2021-06-24T12:00:00;0;2;E;2021-10-28;10000000.00000;C
01;22222222;Cont_2;2021-07-09T12:00:00;0;;REL;,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,;
01;22222222;Cont_3;2021-08-09T12:00:00;0;Y;RVI;1234cod LEI Bco C 899;33333333;;Banco C;CHL;;;;22222222;1234cod LEI Bco B 899;Banco B;;;OTC;;
02;22222222;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;22222222;Cont_3;2021-08-09T12:00:00;0;CLP;7932600000.00000;USD;10000000.00000;;;USD/CLP;793.26000;-4.260000000;0.00000;0.00000
08;22222222;Cont_3;2021-08-09T12:00:00;0;M;CLP;-191067879.00000;0.000000000;0.000000000;0.000000000;0.000000000;353606.00000;0.00000;0.00000
01;22222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;Y;RNU;1234cod LEI Bco C 899;33333333;;Banco C;CHL;;;;22222222;1234cod LEI Bco B 899;Banco B;;;OTC;;
02;22222222;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;22222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;CLP;7487100.00000;USD;10000.00000;;;USD/CLP;748.71000;-1.710000000;0.00000;0.00000
05;22222222;Cont_5;2021-07-09T12:00:00;0;2;E;2021-10-07;10000000.00000;C
```

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



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

| Subyacente | Carga | Validación | Cuadratura por consistencia | Envío | Traspaso histórico |
|--------------------------------|-------|------------|-----------------------------|--------|--------------------|
| CIR-Corrección Mensual Tasas | 0% ✓ | 100% ✓ | 0% | 100% ✓ | 100% ✓ |
| CFV-Corrección Mensual Monedas | 0% ✓ | 100% ✓ | 0% | 100% ✓ | 100% ✓ |
| MIR-Mensual tasas | 0% ✓ | 100% ✓ | 0% | 100% ✓ | 100% ✓ |
| MPX-Mensual monedas | 0% ✓ | 75% ⚠ | 0% | 25% ⚠ | 25% ⚠ |

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**)

Filtros de búsqueda:

Institución: Todos | Informe: CFX-Corrección Mensual Monedas | Tipo fecha: REFERIDA

Tipo: Todos | Sub Tipo: Todos | Categoría: Todos | Desde: 01-03-2022 | Hasta: 31-03-2022

Reportes con problemas de estructura: 0

Estado de reportes en proceso:

31 de marzo de 2022 | Total: 0 | Correctos: 0 | Con errores: 0 | Procesando: 0

| Código reporte | Reportante | Fecha ejecución | Carga | Validación | Coordinatura | Comisaría mensual | Resumen | Emisor reportante | Estado histórico |
|----------------|------------|-----------------|------------------|------------|--------------|-------------------|---------------------------|---|------------------|
| 1 | CFX | Banco B | 18/04/2022 12:22 | ✓ | ✓ | 🔒 | ✓ Resumen | ✓ 18/04/2022 12:23:46 revisar | ✓ |

Con esto último, se da por finalizado el proceso de reporte de rectificación de archivo mensual.

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

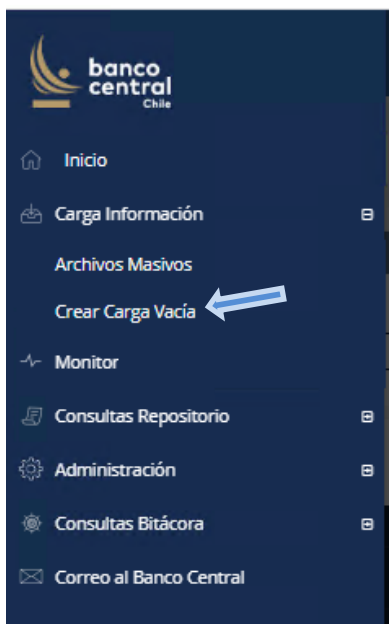
Resumen

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, Renta fija-MIF, Renta variable -MEQ y Materias primas -MCM-), 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):

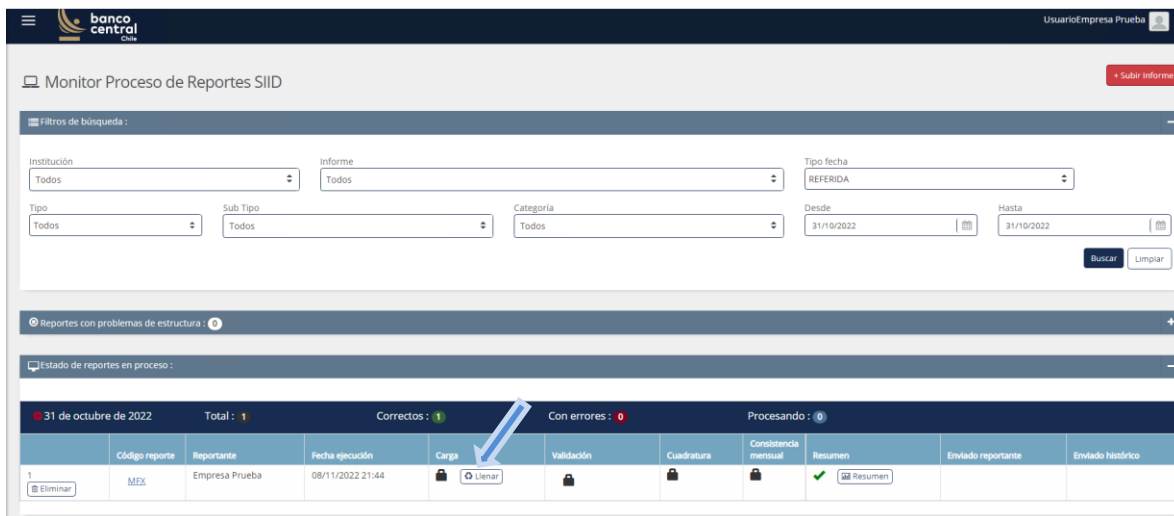


Al marcar esta opción, se desplegará una pantalla en la que se deben completar los campos de identificación del reporte que se desea ingresar, según se muestra en la imagen adjunta. Finalmente, pulsar el botón:

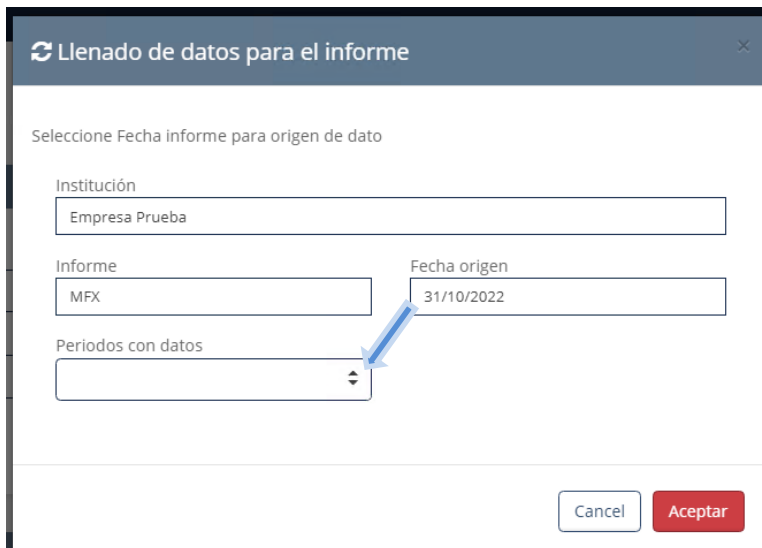
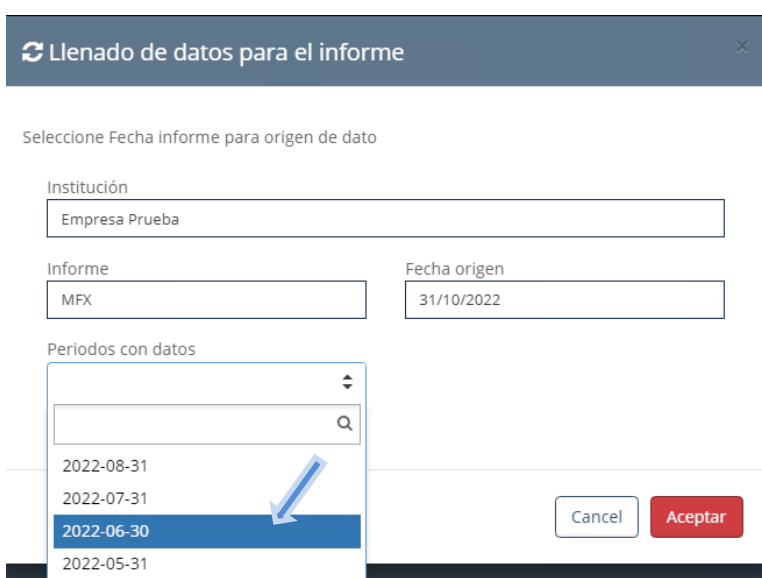
Generar Carga Vacía




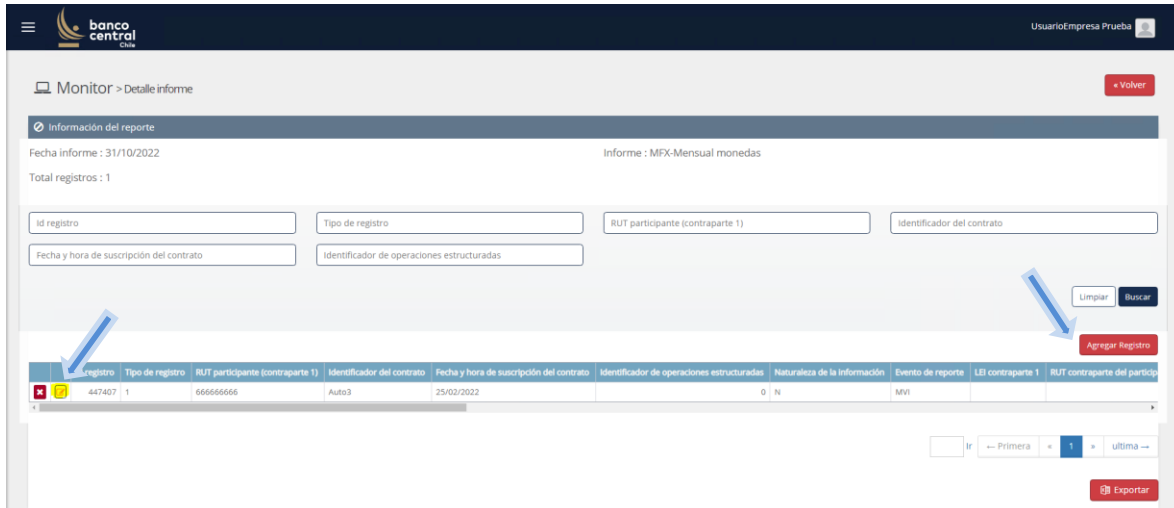
A continuación, En la pantalla del Monitor, columna Carga, aparecerá el siguiente ícono:  



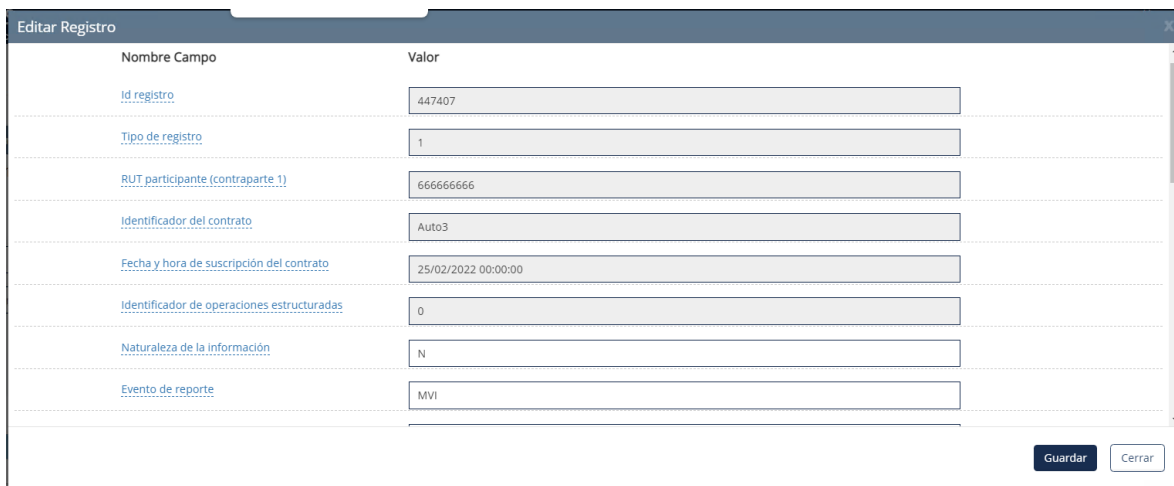
Luego se presenta una nueva pantalla donde el informante debe seleccionar en el campo **Periodos con datos** el mes sobre el cual va a completar la información de los contratos vigentes que haya enviado previamente al sistema. En caso de que no se hayan enviado reportes previos, por ser la primera vez 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:  en la columna de Validación, el cual debe ser pulsado para iniciarán el procesamiento de la carga y validaciones del reporte.

| 31 de diciembre de 2022 | | Total: 1 | Correctos: 1 | Con errores: 0 | Procesando: 0 | | | |
|-------------------------|------------|-----------------|------------------|----------------|----------------------|---------|--------------------|-------------------|
| Código reporte | Reportante | Fecha ejecución | Carga | Validación | Consistencia mensual | Resumen | Enviado reportante | Enviado histórico |
| 1 | MXF | Empresa Prueba | 24/01/2023 11:37 | Lienar | Procesar | | | Resumen |

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

Enviar

| Estado de reportes en proceso : | | | | | | | | | | |
|---------------------------------|------------|-----------------|------------------|---------------|-----------------|----------------------|---------|---------------------------|------------------------|--|
| 31 de diciembre de 2022 | | | Total : 1 | Correctos : 1 | Con errores : 0 | Procesando : 0 | | | | |
| Código reporte | Reportante | Fecha ejecución | Carga | Validación | Cuadratura | Consistencia mensual | Resumen | Enviado reportante | Enviado histórico | |
| 1 | MFJ | Empresa Prueba | 24/01/2023 15:02 | ✓ | ✓ | 🔒 | 🔒 | ✓ Resumen | Enviar | |

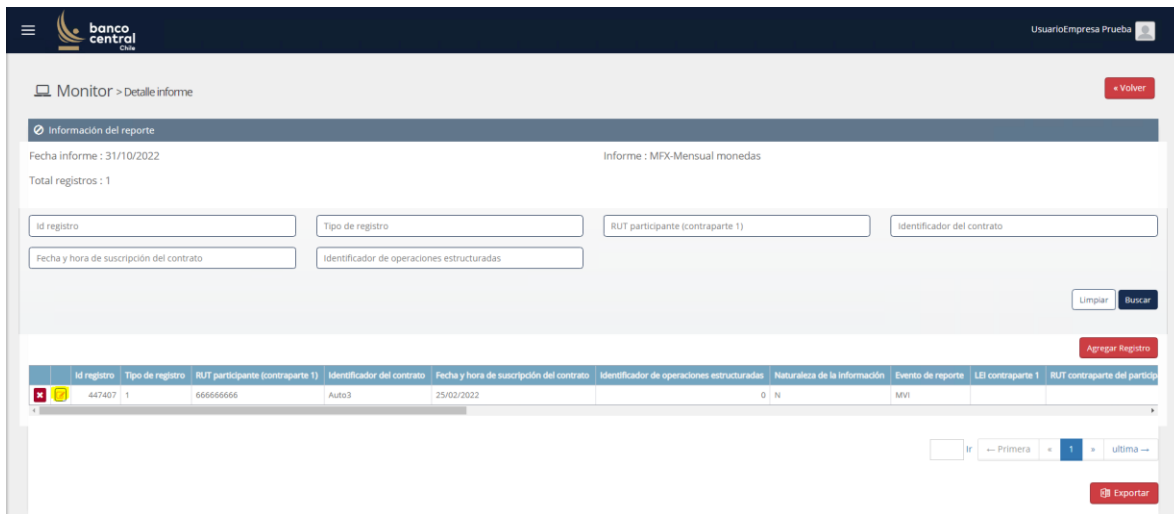
En caso de presentar errores que imposibiliten el envío, estos deben ser corregidos editando la información de los registros correspondientes.

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**

| 31 de octubre de 2022 | | | | | | | | | | |
|-----------------------|------------|-----------------|------------------|-----------------|----------------|----------------------|---------|---------------------------|-------------------|--|
| Total : 3 | | | Correctos : 0 | Con errores : 3 | Procesando : 1 | | | | | |
| Código reporte | Reportante | Fecha ejecución | Carga | Validación | Cuadratura | Consistencia mensual | Resumen | Enviado reportante | Enviado histórico | |
| 1 | MFJ | Empresa Prueba | 24/01/2023 12:11 | ✓ | ✗ | 🔒 | 🔒 | ✓ Resumen | | |
| 2 | MEI | Empresa Prueba | 24/01/2023 12:11 | ✓ | ✗ | 🔒 | 🔒 | ✓ Resumen | | |
| 3 | MIR | Empresa Prueba | 01/12/2022 17:14 | ✗ | 🔒 | 🔒 | 🔒 | | | |

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.



Monitor > Detalle informe

Información del reporte

Fecha informe : 31/10/2022

Informe : MFJ-Mensual monedas

Total registros : 1

Id registro:

Tipo de registro:

RUT participante (contraparte 1):

Identificador del contrato:

Fecha y hora de suscripción del contrato:



Identificador de operaciones estructuradas:

[Limpiar](#) [Buscar](#)

[Agregar Registro](#)

| Id registro | Tipo de registro | RUT participante (contraparte 1) | Identificador del contrato | Fecha y hora de suscripción del contrato | Identificador de operaciones estructuradas | Naturaleza de la Información | Evento de reporte | LEI contraparte 1 | RUT contraparte del participante |
|-------------|------------------|----------------------------------|----------------------------|--|--|------------------------------|-------------------|-------------------|----------------------------------|
| 447407 | 1 | 66666666 | Auto3 | 25/02/2022 | | O N | MVI | | |

[Exportar](#)

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.

Editar Registro

Id registro

Tipo de registro

RUT participante (contraparte 1)

Identificador del contrato

Fecha y hora de suscripción del contrato

Identificador de operaciones estructuradas

Naturaleza de la información

Evento de reporte

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

| Estado de reportes en proceso : | | | | | | | | | | |
|---|------------|-----------------|------------------|------------|----------|------------|----------------------|--|--------------------|-------------------|
| 31 de diciembre de 2022 | | | | | | | | | | |
| Total : 1 Correctos : 1 Con errores : 0 Procesando : 0 | | | | | | | | | | |
| Código reporte | Reportante | Fecha ejecución | Carga | Validación | Procesar | Cuadratura | Consistencia mensual | Resumen | Enviado reportante | Enviado histórico |
| 1 | MEX | Empresa Prueba | 24/01/2023 11:48 | ✓ | ✓ | 🔒 | 🔒 | ✓ <input type="button" value="Resumen"/> | | |

Se recomienda revisar el resumen del reporte antes de proceder con el envío de este, para verificar que los registros cargados son los que corresponden.

| Estado de reportes en proceso : | | | | | | | | | | |
|---|------------|-----------------|------------------|------------|----------|------------|----------------------|--|---------------------------------------|-------------------|
| 31 de diciembre de 2022 | | | | | | | | | | |
| Total : 1 Correctos : 1 Con errores : 0 Procesando : 0 | | | | | | | | | | |
| Código reporte | Reportante | Fecha ejecución | Carga | Validación | Procesar | Cuadratura | Consistencia mensual | Resumen | Enviado reportante | Enviado histórico |
| 1 | MEX | Empresa Prueba | 24/01/2023 15:02 | ✓ | ✓ | 🔒 | 🔒 | ✓ <input type="button" value="Resumen"/> | <input type="button" value="Enviar"/> | |

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

| Estado de reportes en proceso : | | | | | | | | | | |
|---|------------|-----------------|------------------|------------|----------|------------|----------------------|--|---------------------------------------|-------------------|
| 31 de diciembre de 2022 | | | | | | | | | | |
| Total : 1 Correctos : 1 Con errores : 0 Procesando : 0 | | | | | | | | | | |
| Código reporte | Reportante | Fecha ejecución | Carga | Validación | Procesar | Cuadratura | Consistencia mensual | Resumen | Enviado reportante | Enviado histórico |
| 1 | MEX | Empresa Prueba | 24/01/2023 15:02 | ✓ | ✓ | 🔒 | 🔒 | ✓ <input type="button" value="Resumen"/> | <input type="button" value="Enviar"/> | |