



GOBIERNO DE CHILE
SUPERINTENDENCIA DE AFP

CIRCULAR N° 13

VISTOS: Las facultades que confiere la Ley a esta Superintendencia, se imparten las siguientes instrucciones de cumplimiento obligatorio para la Sociedad Administradora de Fondos de Cesantía.

REF.: ESTABLECE NORMAS SOBRE INFORMACIÓN DE LAS CARTERAS DE INVERSIÓN Y DEL CORTE DE CUPÓN DE LOS INSTRUMENTOS FINANCIEROS CORRESPONDIENTES A LOS FONDOS DE CESANTÍA.

Introducción

La presente Circular establece normas sobre la información de la cartera de instrumentos financieros y del corte de cupón de los Fondos de Cesantía que debe remitir la Sociedad Administradora.

I. Carteras de inversión de los Fondos de Cesantía.

1. La Sociedad Administradora de Fondos de Cesantía, deberá proporcionar a esta Superintendencia información relativa a las carteras de inversión de los Fondos de Cesantía.
2. Con tal objeto, la Sociedad Administradora deberá enviar a esta Superintendencia, vía transmisión electrónica de datos, la información acerca de los instrumentos financieros que componen la cartera de inversión de los Fondos de Cesantía.

Ante la eventualidad de no poder realizarse la transmisión electrónica de datos a que se alude en el párrafo anterior, dicha información deberá ser enviada mediante un diskette de alta densidad, previa autorización de esta Superintendencia.

3. La referida información, tanto para el caso de transmisión electrónica de datos, como en diskette, deberá estar contenida en archivos generados conforme a las especificaciones impartidas en el anexo N°1 “Instrucciones para el envío de la cartera de inversiones de los Fondos de Cesantía”, que forma parte de esta Circular.
4. Cada registro de estos archivos deberá incluir los campos que se describen a continuación:
 - a. Administrador de Cartera

En este campo deberá indicarse la sigla de tres caracteres, asignada por esta Superintendencia, que identifica al administrador de la cartera o al mandatario extranjero que a la fecha de la información es responsable de la administración del instrumento financiero informado. En el caso que la administración del instrumento sea realizada por la propia Sociedad Administradora de Fondos de Cesantía, se deberá indicar en este campo la sigla "CPA".

Al respecto, esta Superintendencia podrá requerir información de todos los instrumentos de la cartera de los Fondos de Cesantía que se refieran a un tipo de administrador específico.

b. Tipo de Custodia.

Se deberá indicar el tipo de custodia de acuerdo al siguiente esquema:

LOC	Cuando el instrumento se encuentre en custodia local.
DCV	Cuando el instrumento se encuentre en el Depósito Central de Valores.
SIN	Cuando el instrumento no se encuentre en custodia.
PRN	Cuando el instrumento nacional se encuentre otorgado en mutuo o préstamo.
PRE	Cuando el instrumento extranjero se encuentre otorgado en mutuo o préstamo.
TOT	Cuando se informe el total de la cartera sin hacer distinción por custodia.

En el caso que el instrumento se encuentre en custodia en el extranjero, se deberá indicar la sigla de tres caracteres que identifica a la entidad encargada de la custodia, la que será proporcionada por la Superintendencia.

Este campo se deberá informar con la sigla TOT, salvo que esta Superintendencia instruya expresamente lo contrario.

En el caso que esta Superintendencia solicite informar la cartera de inversiones de los Fondos de Cesantía separada por custodio, en este campo se deberán informar las siglas antes indicadas, de acuerdo a la custodia en la cual se encuentren los instrumentos al cierre del día respecto del cual se requirió la información. Asimismo, esta Superintendencia podrá requerir información de todos los instrumentos de la cartera de los Fondos de Cesantía que se refieran a un custodio específico, o que se encuentren otorgados en mutuo o préstamo o bien que no se encuentren en custodia.

c. Tipo de instrumento

Se debe indicar la abreviatura correspondiente al tipo de instrumento que se informa. Para ello deberá utilizarse el código del instrumento que se indica en la Circular que regula la elaboración y envío del Informe Diario.

d. Instrumento objeto

Se deberá indicar el instrumento objeto para el caso de contratos de opciones, futuros y forwards de tasas de interés, de acuerdo a lo señalado en la Circular que regula la elaboración y envío del Informe Diario.

e. Nemotécnico o serie del instrumento

Se deberá indicar el nemotécnico o la serie del instrumento de acuerdo a lo establecido en la Circular que regula la elaboración y envío del Informe Diario.

f. Precio de ejercicio o del contrato

Se deberá indicar el precio de ejercicio del contrato cuando corresponda, de acuerdo a lo establecido en la circular que regula la elaboración y envío del Informe Diario.

g. Fecha de Vencimiento

Corresponde a la fecha de vencimiento del instrumento, la cual se expresará en la forma AAAAMMDD.

h. Unidades

Se deberá indicar el número de unidades que se poseen del instrumento. Para la información de las unidades correspondientes a los Bonos Cora, deberá considerarse el valor nominal de emisión del documento, sin hacer distinción si se trata de escudos (E) o pesos (\$). Para el caso de instrumentos de intermediación financiera se informará el valor final de éstos, expresado en la unidad de reajuste o en pesos, según corresponda. En el caso de instrumentos derivados se informará el número de unidades de acuerdo a lo señalado en la Circular que regula la elaboración y envío del Informe Diario.

i. Precio unitario

Se deberá indicar el precio unitario al que está valorado el instrumento, expresado en pesos y centavos, de acuerdo a lo señalado en la circular que regula la elaboración y el envío del Informe Diario.

j. Valor total

Se deberá indicar el valor total expresado en pesos, de las unidades informadas por cada instrumento, de acuerdo a lo señalado en la circular que regula la elaboración y el envío del Informe Diario.

5. La información de las carteras de inversión de los Fondos de Cesantía, correspondiente a los últimos 30 días, contados desde la fecha de su requerimiento, deberá estar disponible para su transmisión inmediata a esta Superintendencia.
6. La Sociedad Administradora deberá efectuar las transmisiones electrónicas de datos con la información de las carteras de inversiones de los Fondos de Cesantía,

correspondientes al último día hábil de cada mes, a más tardar, a las 16:00 horas del día hábil siguiente. En tal caso, se deberá informar en el campo *Tipo de custodia* la sigla TOT, salvo que esta Superintendencia disponga expresamente lo contrario.

II. Corte de cupón.

1. La Sociedad Administradora de Fondos de Cesantía deberá proporcionar a este Organismo Fiscalizador la información referente al corte de cupón de los instrumentos financieros pertenecientes a la cartera de los Fondos de Cesantía.
2. Para tales efectos, la Sociedad Administradora de Fondos de Cesantía deberá remitir a esta Superintendencia, vía transmisión electrónica de datos, la información referente al corte de cupón de un día específico cada vez que ésta lo requiera, es decir, transmitirá la información correspondiente de todos los instrumentos que corten cupón al día requerido. Sin perjuicio de lo anterior, también se transmitirá la información en forma mensual correspondiente al período comprendido entre el segundo día hábil del mes anterior y el primer día hábil del mes en el cual se debe realizar la transmisión.

En el evento de no poder realizar la transmisión electrónica de datos, la información deberá ser enviada mediante un diskette de alta densidad, previa autorización de esta Superintendencia.

3. La referida información, tanto para el caso de transmisión electrónica de datos como en diskette, deberá estar contenida en archivos generados conforme a las especificaciones impartidas en el anexo N°2 "Instrucciones para el envío de la cartera de los Fondos de Cesantía, referente al Corte de Cupón", que forma parte de esta Circular.
4. Los archivos con la información mensual de corte de cupón deberán transmitirse, a más tardar, a las 16:00 horas del quinto día hábil de cada mes. Para el caso de la información requerida para un día específico, ésta se deberá remitir en el día que ésta es solicitada. Tanto para la información mensual como diaria requerida, se incluirán los campos que se describen a continuación:

a. Tipo de instrumento.

Se deberá indicar la abreviatura correspondiente al tipo de instrumento que se informa. Ésta deberá corresponder a alguno de los códigos de instrumento que se indican en la Circular que regula la elaboración y envío del Informe Diario.

b. Nematécnico o serie del instrumento.

Se deberá indicar el nemotécnico o la serie del instrumento de acuerdo a lo establecido en la Circular que regula la elaboración y envío del Informe

Diario.

- c. Tipo de moneda.

Se deberá indicar la moneda de emisión en que está expresado el instrumento.

- d. Unidades.

Corresponde señalar el número de unidades del instrumento informado que cortó cupón.

- e. Valor total del corte de cupón en unidades indexadas o moneda extranjera.

Se deberá indicar el monto en unidades indexadas o moneda extranjera del corte de cupón que le corresponde a cada instrumento.

- f. Valor total del corte de cupón.

Se deberá señalar el monto en pesos del corte cupón que corresponde a cada instrumento.

- g. Fecha del corte de cupón.

Se deberá indicar la fecha en que se cortó cupón del instrumento. Ésta deberá estar expresada de la forma AAAAMMDD.

III. Vigencia

La presente Circular comenzará a regir a contar del 1° de octubre de 2002.

ALEJANDRO FERREIRO YAZIGI
Superintendente de A.F.P.

Santiago, 01 de AGOSTO de 2002.



GOBIERNO DE CHILE
SUPERINTENDENCIA DE AFP

ANEXO N° 1
Instrucciones para el envío de la Cartera de inversiones de los
Fondos de Cesantía

1. Introducción.

El envío de la cartera de inversiones de los Fondos de Cesantía debe realizarse de acuerdo con las especificaciones y modalidad de transmisión definidas en la Circular de transmisión de datos de los Fondos de Cesantía.

2. Descripción del registro.

Archivo: PCaammdd.afc		
Tipo de Registro: Identificación		
Información del Campo	Tamaño	Formato
Administrador de cartera	X(03)	
Tipo de custodia	X(03)	
Tipo de instrumento	X(04)	
Instrumento objeto	X(16)	
Nemotécnico o serie del instrumento	X(16)	
Precio de ejercicio o del contrato	9(12)V9(10)	
Fecha de vencimiento	9(08)	AAAAMMDD
Unidades	9(12)V9(04)	
Precio Unitario	9(12)V9(06)	
Signo	X(01)	+/-
Valor Total	9(14)	
Signo	X(01)	+/-
Largo del Registro	X(122)	

Notas:

- Los campos alfanuméricos deben estar alineados a la izquierda, completando su tamaño con blancos.
- Los campos numéricos deben estar alineados a la derecha, completando su tamaño con ceros.



GOBIERNO DE CHILE
SUPERINTENDENCIA DE AFP

ANEXO N° 2
Instrucciones para el envío de la Cartera de los Fondos de Cesantía
referente al Corte de Cupón

1. Introducción.

El envío de la cartera de inversiones de los Fondos de Cesantía referente al Corte de Cupón debe realizarse de acuerdo con las especificaciones y modalidad de transmisión definidas en la Circular de transmisión de datos de los Fondos de Cesantía.

2. Descripción del Registro

Archivo: CCaammdd.afc		
Información del Campo	Tamaño	Contenido o Formato
Tipo de instrumento	X(04)	
Nemotécnico o serie del instrumento	X(16)	
Tipo de moneda	X(04)	
Unidades	9(12)V9(04)	
Signo	X(01)	+/-
Valor total del corte de cupón en U.I.	9(12)V9(05)	
Signo	X(01)	+/-
Valor total del corte de cupón en pesos	9(12)	
Signo	X(01)	+/-
Fecha del corte de cupón	9(08)	AAAAMMDD
Largo del Registro	X(80)	

Notas:

- Los campos alfanuméricos deben estar alineados a la izquierda, completando su tamaño con blancos.
- Los campos numéricos deben estar alineados a la derecha, completando su tamaño con ceros.