



CIRCULAR N° 1212

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

REF.: ESTABLECE NORMAS SOBRE INFORMACIÓN DE LAS CARTERAS DE INVERSIÓN Y DEL CORTE DE CUPÓN DE LOS FONDOS DE PENSIONES. DEROGA CIRCULAR N° 1106 DE FECHA 11 DE NOVIEMBRE DE 1999.

Introducción

La presente Circular referida a la información de la cartera de inversión y del corte de cupón de los Fondos de Pensiones que deben presentar las Administradoras, tiene por objeto incorporar las modificaciones introducidas al D.L. 3.500 de 1980 por la ley N° 19.795 publicada en el Diario Oficial de fecha 28 de febrero de 2002, relativa a la incorporación de los multifondos.

I. Carteras de inversión de los Fondos de Pensiones.

1. Las Administradoras de Fondos de Pensiones, deberán proporcionar a esta Superintendencia información relativa a las carteras de inversión de cada uno de los Tipos de Fondos de Pensiones, en forma separada e independiente.
2. Con tal objeto, las Administradoras deberán enviar a esta Superintendencia, vía transmisión electrónica de datos, la información acerca de los instrumentos financieros que componen cada una de las carteras de inversión de cada uno de los Tipos de Fondos de Pensiones que administre.

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 la recepción de las carteras de inversión de los Fondos de Pensiones", 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

Administradora de Fondos de Pensiones, se deberá indicar en este campo la sigla "CPA".

2

Al respecto, esta Superintendencia podrá requerir información de todos los instrumentos de la cartera de un tipo de Fondo de Pensiones 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 un determinado Tipo de Fondo separada por custodia, 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 un Tipo de Fondo de Pensiones 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.

4

5. La información de las carteras de inversión de cada uno de los Tipos de Fondos de Pensiones, correspondiente a los últimos 30 días, contados desde la fecha de su requerimiento, deberá estar disponible para su transmisión inmediata a esta Superintendencia.
6. Las Administradoras deberán efectuar las transmisiones electrónicas de datos con la información de las carteras de inversiones de cada uno de los Tipos de Fondos de Pensiones, correspondientes al último día hábil de cada mes, a más tardar, a las 24:00 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. Las Administradoras deberán proporcionar a este Organismo Fiscalizador la información referente al corte de cupón de los instrumentos financieros pertenecientes a la cartera de cada uno de los Tipos de Fondos de Pensiones.
2. Para tales efectos, las Administradoras deberán 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 la recepción de las carteras de los tipos de Fondos de Pensiones, referentes a Corte de Cupón", que forma parte de esta Circular.

4. Los archivos con la información mensual de corte de cupón deberán transmitirse,

5

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. Nemo-técnico o serie del instrumento.

Se deberá indicar el nemo-técnico 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.

6

III. Derogación

Derógase la Circular N° 1.106 de fecha 11 de noviembre de 1999.

IV. Vigencia

La presente Circular comenzará a regir a contar del primero de agosto de 2002.

ALEJANDRO FERREIRO YAZIGI
Superintendente de A.F.P.

Santiago, 25 de JUNIO de 2002.



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

Introducción.

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

2. Descripción del registro.

Archivo: PCtfaammdd.ext		
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.



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

Introducción.

El envío de la Cartera de inversiones de los Fondos de Pensiones 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 Pensiones.

2. Descripción del Registro

Archivo: CCifaammdd.ext		
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.