

**SUPERINTENDENCIA DE ADMINISTRADORAS
DE FONDOS DE PENSIONES**

CIRCULAR N° 563

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

REF: INFORMACION DE LAS CARTERAS DE INVERSIONES DEL FONDO DE PENSIONES Y DEL ENCAJE: DEROGA CIRCULAR N° 301

1. Las Administradoras de Fondos de Pensiones deberán entregar mensualmente a esta Superintendencia información relativa a las carteras de inversiones del Fondo de Pensiones y del Encaje.
2. Con tal objeto, las Administradoras deberán enviar a este organismo fiscalizador una cinta magnética que tenga la información de los instrumentos financieros que componen las carteras de inversiones del Fondo de Pensiones y del Encaje, referida al cierre del último día hábil de cada mes.
3. LA citada información deberá estar dispuesta en la cinta magnética de acuerdo a las especificaciones impartidas en el anexo " Instrucciones de información mensual de las carteras de inversión en cinta magnética ", que se adjunta a esta Circular.
4. La información mensual de las carteras de inversión deberá ser entregada en la Oficina de Partes de esta Superintendencia antes de las 16 Hrs. del día hábil siguiente al último día de cada mes. La cinta se deberá remitir acompañada de una carta suscrita por el Gerente General de la Administradora en la cual se señale, a lo menos, lo siguiente:
 - a) Contenido de la información en cinta magnética.
 - b) Fecha a la cual esta referida la información.
 - c) Valor de las carteras de inversiones del Fondo de Pensiones y del Encaje a la fecha señalada en la letra b anterior.

5. La información en cinta magnética deberá estar dispuesta en un registro que se compondrá de 13 campos. El orden y contenido de cada una de ellos será el siguiente:

- Primer campo : Tipo de cartera

Se deberá indicar si el instrumento informado en esa fila corresponde a la cartera del Fondo o del Encaje, con una letra F o una E, respectivamente.

- Segundo campo : Tipo de instrumento

Se deberá indicar la abreviatura correspondiente al tipo de instrumento que se informa. Esta deberá corresponder a alguno de los códigos de instrumentos que aparecen señalados en la letra I de la Circular N° 478 de esta Superintendencia.

- Tercer campo : RUT del emisor.

Se deberá indicar el RUT del emisor de acuerdo a las instrucciones impartidas en la letra E, número 2 de la Circular N° 478, para el caso de los instrumentos seriados y acciones y para el de los instrumentos únicos, respectivamente.

- Cuarto campo : Serie del documento.

Se deberá indicar la serie del documento de acuerdo a las instrucciones impartidas en la letra E, número 2 y en la letra F, número 2, de la Circular N° 478, para el caso de los instrumentos seriados y el de los únicos, respectivamente.

- Quinto campo : Fecha de emisión.

Corresponde a la fecha en la cual fue emitido el instrumento . Esta deberá estar expresada en la forma AAMMDD. En el caso de los PDC, se debe informar la fecha de adquisición del instrumento y en el caso de las cuotas de otros Fondos, se indicará la fecha en que se adquirieron dichas cuotas.

- Sexto campo : Número del instrumento. (solo para el caso de los instrumentos únicos)

Se deberá indicar el número del instrumento de acuerdo a las instrucciones impartidas en la letra F, número 2 de la Circular N° 478.

- Séptimo campo : Fecha de vencimiento.

Es la fecha de vencimiento del instrumento, la cual se expresa en AAMMDD.

- Octavo campo : Unidades

Número de unidades que se poseen del instrumento. Este valor se informará con dos decimales cuando corresponda. 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 únicos, el número de unidades es igual a 1.

- Noveno campo : Precio unitario

Se deberá indicar el precio unitario, expresado en pesos y centavos, al cual el instrumento esta valorado. Para el caso de instrumentos únicos, el precio unitario es igual al valor total.

- Décimo campo : Valor total

Se deberá indicar el valor total expresado en pesos, de las unidades informadas por cada instrumento, sin decimales.

- Décimoprimer campo : Monto inicial (Sólo para el caso de los instrumentos únicos)

Es el valor inicial del documento, expresado en pesos. Cuando este valor no exista por tratarse de documentos comprados con documento (por Ej. PDC o letra de cambio avalada), esta columna deberá dejarse en blanco.

- Decimosegundo campo : Monto de intereses (Sólo para el caso de los instrumentos únicos)

Esta columna corresponde el valor de los intereses, a la fecha de emisión informada, que devengará el instrumento durante su vigencia. Este monto deberá estar expresado en pesos y no considera reajustes.

- Decimotercer campo : Fecha a partir de la cual se devengan intereses (Sólo para el caso de instrumentos unicos)

Se deberá indicar la fecha de inicio del devengamiento de interes del instrumento, la cual será de la forma AAMMDD.

Por ejemplo, para el caso de los PDC la fecha de inicio del devengamineto de intereses será la fecha de emisión informada en su oportunidad.

6. La información de las carteras del Fondo y del Encaje deberá estar disponible para los últimos 30 días calendarios, contados desde la fecha del requerimiento, pudiendo esta ser solicitada en cualquier momento por esta Sperintendencia, en cuyo caso tal infoemación se remitira en la forma señalada en los números 3 y 5 de esta circular.

7. Vigencia.

Las instrucciones impartidas en la presente circular regirán a contar del 1o. de enero de 1989, excepto lo dispuesto en el número 6 que regirán a contar del 31 de enero de 1989.

En consecuencia, la primera información de carteras deberá remitirse a esta Superintendencia el día 1o. de febrero de 1989.

JUAN ARIZTIA MATTE
Superintendente de AFP

**SUPERINTENDENCIA DE ADMINISTRADORAS
DE FONDOS DE PENSIONES**

Santiago, 22 de DICIEMBRE de 1988.

ANEXO

Instrucciones de información mensual de las carteras de inversión en cinta magnetica.

Descripción del registro :

Descripción	Formato
Tipo de Cartera (F/E	X(01)
Tipo de instrumento	X(03)
Filler	X(01)
R.U.T. del emisor	X(09)
Serie del instrumento	X(08)
Fecha de emisión	9(06)
Número del instrumento	X(12)
Fecha vencimiento	9(06)
Unidades	9(12)V9(02)
Precio unitario	9(12)V9(02)
Valor total	9(14)
Monto de incial	9(14)
Monto de intereses	9(14)
Fecha de inicio de devengue	9(06)
Filler	X(38)

1. Las fechas deben ser expresadas de la forma aammdd, donde aa es el año, mm es el mes y dd es el día.
2. Los filler deben contener sólo blancos.
3. los campos tipo X deben estar aliniados a la izquierda, completando su tamaño con blancos.
4. Los campos tipo 9 deben estar aliniados a la derecha, completando su tamaño con ceros.

Especificaciones de grabación de cinta :

1. Densidad de grabación : 1600bpi.
2. Código de grabación : EBCDIC.
3. Factor de bloqueo : 20 registros por bloque.
4. largo del registro : 160 caracteres.
5. Cinta sin label.

Los archivos deben venir ordenados , (clase de ordenamiento, el registro) y las cintas magnéticas tendrán que ser identificadas con una etiqueta que contenga el nombre de la A.F.P. y la frase " Cartera de instrumentos" al día que corresponda.