

**SUPERINTENDENCIA DE ADMINISTRADORAS
DE FONDOS DE PENSIONES**

CIRCULAR N° 855

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.: ESTABLECE NORMAS SOBRE INFORMACION DE LA CARTERA DE INVERSION DEL FONDO DE PENSIONES: DEROGA LA CIRCULAR No. 563.

I. Normas de Carácter General

1. Las Administradoras de Fondos de Pensiones deberán entregar mensualmente a esta Superintendencia información relativa a la cartera de inversiones del Fondo de Pensiones.
2. Con tal objeto, las Administradoras deberán enviar, vía transmisión de datos, a este Organismo fiscalizador la información de los instrumentos financieros que componen la cartera de inversiones del Fondo de Pensiones, referida al último día hábil de cada mes.

Ante la eventualidad de no poder realizarse la transmisión, la información deberá ser enviada mediante cinta magnética, previa autorización de esta Superintendencia.

3. La citada información deberá estar dispuesta, tanto para el caso de la transmisión como el de la cinta magnética, de acuerdo a las especificaciones impartidas en el anexo "Instrucciones de información mensual de la cartera de inversión", que se adjunta a esta Circular.

**SUPERINTENDENCIA DE ADMINISTRADORAS
DE FONDOS DE PENSIONES**

2

4. La información mensual de la cartera de inversiones deberá transmitirse antes de las 16 hrs. del día hábil siguiente al último día de cada mes. La transmisión deberá ser acompañada de una carta suscrita por el Gerente General de la Administradora en la cual se señale, al menos, lo siguiente:
- a. Contenido de la información enviada vía transmisión de datos
 - b. Fecha a la cual está referida la información
 - c. Valor de la cartera de inversiones del Fondo de Pensiones a la fecha señalada en la letra b anterior.
5. La información deberá estar dispuesta en un registro que se compondrá de 12 campos. El orden y el contenido de cada uno de ellos será el siguiente:

- Primer 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 No. 478 de esta Superintendencia.

- Segundo Campo: RUT del emisor, si se trata de emisores nacionales, o Código del emisor, si se trata de emisores extranjeros.

Se deberá indicar el RUT del emisor o Código del emisor de acuerdo al siguiente esquema:

<u>Tipo de instrumento</u>	<u>Numeral de la Circular No.478</u>
- Seriados y Acciones Nacionales	- Código 96.12 del numeral E.2
- Unicos Nacionales	- Código 96.12 del numeral F.2
- Seriados Extranjeros	- Código 96.32 del numeral R.2
- Unicos Extranjeros	- Código 96.32 del numeral S.2

En el caso de los instrumentos nacionales, se debe ampliar en un carácter el largo del campo, agregando un carácter blanco al principio de éste, quedando de largo 10.

- Tercer Campo: Serie del Documento

Se deberá indicar la serie del documento de acuerdo al siguiente esquema:

<u>Tipo de Instrumento</u>	<u>Numeral de la Circular No.478</u>
- Seriados y Acciones Nacionales	- Letras e) y h) del numeral E.1 y código 96.13 del numeral E.2
- Unicos Nacionales	- Código 96.13 del numeral F.2
- Seriados Extranjeros	- Letras e) e i) del numeral R.1 y código 96.33 del numeral R.2
- Unicos Extranjeros	- Código 96.33 del numeral S.2

El largo de este campo deberá ser de 16 caracteres, debiéndose agregar los caracteres blancos necesarios a la derecha de este campo.

- Cuarto 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 instrumentos que se transen con descuento, se debe informar la fecha de adquisición del instrumento.

- Quinto Campo: Número del Instrumento (sólo para el caso de los instrumentos únicos).

Se deberá indicar el número del instrumento de acuerdo al siguiente esquema:

<u>Tipo de Instrumento</u>	<u>Numeral de la Circular No.478</u>
- Únicos Nacionales	- Código 96.15 del numeral F.2
- Únicos Extranjeros	- Código 96.15 del numeral S.2

- Sexto Campo: Fecha de Vencimiento

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

- Séptimo 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.

- Octavo Campo: Precio Unitario

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

- Noveno Campo: Valor Total

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

- Décimo Campo: Monto Inicial (Sólo para el caso de los Instrumentos Unicos)

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

- Decimoprimer Campo: Monto de Intereses (Sólo para el caso de Instrumentos Unicos)

Esta columna corresponde al 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.

- Decimosegundo Campo: Fecha a partir de la cual se devengan intereses (Sólo para el caso de los Instrumentos Unicos).

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

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

6. La información de la cartera del Fondo de Pensiones deberá estar disponible para los últimos 30 días calendario, contados desde la fecha del requerimiento, pudiendo ésta ser solicitada en cualquier momento por esta Superintendencia, en cuyo caso tal información se remitirá en la forma señalada en los números 3 y 5 de esta circular.

II. Normas Transitorias

1. Durante el primer semestre de 1995, las Administradoras deberán observar las siguientes normas transitorias para la transmisión de información de las carteras de inversión del Fondo de Pensiones, en razón de que en este período podrán mantener todo o parte del Encaje invertido en instrumentos financieros.

a) Las normas del Capítulo I de la presente Circular, que se refieran a la cartera de inversión del Fondo de Pensiones, se entenderán referidas también a aquella parte del encaje invertida en instrumentos financieros.

b) En el número 5 del Capítulo I de esta Circular deberá agregarse el siguiente campo, que pasará a ser el primer campo:

Tipo de Cartera: deberá indicarse si el instrumento informado corresponde a la cartera del fondo o del encaje, con una letra F o una E, respectivamente.

Por efectos de la agregación del campo antes señalado, los campos contemplados bajo los ordinales primero al decimosegundo, durante este período transitorio pasarán a ser segundo al decimotercero, respectivamente.

c) La carta establecida en el número 4 del Capítulo I de la presente Circular, deberá indicar, adicionalmente, el valor de la cartera de instrumentos financieros del Encaje, en la medida que éste aún no se haya invertido completamente en cuotas del Fondo de Pensiones.

2. La última información de carteras que deba enviarse a esta Superintendencia de conformidad a las normas de la Circular No. 563, deberá estar referida al cierre del último día hábil del mes de diciembre de 1994.

III. Vigencia

La presente Circular entrará en vigencia el 1 de enero de 1995.

IV. Derogación

Derógase la Circular No. 563 de fecha 22 de diciembre de 1988 a contar del 1 de enero de 1995.

JULIO BUSTAMANTE JERALDO
Superintendente de AFP

Santiago, 27 de DICIEMBRE de 1994.

Instrucciones para la recepción de información en cinta magnética o vía transmisión de datos de las carteras de las A.F.P.

El envío de la cartera de inversiones desde las A.F.P. debe realizarse vía transmisión directa de datos a los equipos computacionales de la Superintendencia de A.F.P., y sólo ante una autorización de esta Superintendencia podrá recurrirse a envío por medio de cinta magnética.

1. Especificaciones Técnicas de grabación de cintas

El archivo que se incluya en la cinta magnética deberá cumplir con las siguientes especificaciones:

- Densidad de grabación : 1600 bpi.
- Código de grabación : EBCDIC.
- Factor de bloqueo : 20 registros por bloque.
- Largo del registro : 160 caracteres.
- Cinta sin label.

2. Descripción del registro :

Tipo de Cartera (F/E)	X(01)
Tipo de instrumento	X(03)
Filler	X(01)
Nacionalidad	X(01)
R.U.T. del emisor	X(09)
Serie del instrumento	X(16)
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)
Valor incial	9(14)
Monto de intereses	9(14)
Fecha de inicio de devengue	9(06)
Filler	X(29)
Total	x(160)

Notas:

1. El archivo debe venir ordenado , (clase de ordenamiento, el registro) y las cinta magnética tendrá que ser identificada con una etiqueta que contenga el nombre de la A.F.P. y la frase " Cartera de instrumentos" al día que corresponda
2. Las fechas deben ser expresadas de la forma aammdd, donde aa es el año, mm es el mes y dd es el día.
3. Los filler deben contener sólo blancos.
4. Los campos tipo X deben estar aliniados a la izquierda, completando su tamaño con blancos.
5. Los campos tipo 9 deben estar aliniados a la derecha, completando su tamaño con ceros.