

**SUPERINTENDENCIA DE ADMINISTRADORAS
DE FONDOS DE PENSIONES**

CIRCULAR N°1899

**INFORMES DIARIOS QUE DEBEN PRESENTAR LAS ADMINISTRADORAS.
MODIFICA CIRCULAR N°1478.**

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.

I. INTRODUCENSE LAS SIGUIENTES MODIFICACIONES A LA CIRCULAR N°1478.

A. Modificaciones a la letra C.

5

1. Sustitúyese en el ítem 1.4.2, el código 491.96, por el siguiente:

"491.96 Variación en pesos del Encaje y su equivalente en cuotas.

La variación en pesos del Encaje corresponde a la diferencia algebraica de los ítemes 491.92 y 491.93, incrementada o deducida por el ítem 491.94. La variación en cuotas del Encaje corresponde a la diferencia algebraica de los ítemes 491.92 y 491.93".

2. Agréganse en el ítem 1.7.1. los siguientes códigos:

"791.60 Derechos por contratos de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión inmobiliarios.

Corresponde al valor en pesos que mantiene el Fondo de Pensiones por concepto de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión inmobiliarios.

791.70 Derechos por contratos de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión de desarrollo de empresas.

¡Error! No se encuentra el origen de la referen

Corresponde al valor en pesos que mantiene el Fondo de Pensiones por concepto de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión de desarrollo de empresas."

3. Agréganse en el ítem 1.7.2. los siguientes códigos:

"792.60 Obligaciones por contratos de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión inmobiliarios.

Corresponde al valor en pesos que mantiene el Fondo de Pensiones por concepto de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión inmobiliarios.

792.70 Obligaciones por contratos de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos inversión de desarrollo de empresas.

Corresponde al valor en pesos que mantiene el Fondo de Pensiones por concepto de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión de desarrollo de empresas."

B. Modificaciones a la letra E

1. Agrégase la siguiente letra l. al párrafo E.1, Instrucciones Generales:

l) Cada vez que se informe un ejercicio de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión (letra P en el código 96.25), se debe informar en la columna del código 96.11 los tipos de instrumentos PFI o PFK según corresponda. De esta forma en el stock de la cartera de inversiones del Fondo de Pensiones quedarán registradas como CFI o CFK las unidades que se están ejerciendo.

2. Introdúcense las siguientes modificaciones al párrafo E.2, Instrucciones Específicas:

a. Sustitúyese el código 96.14, por el siguiente:

"96.14 Fecha de emisión

Es la fecha en la cual fue emitido el instrumento. En el caso de acciones, cuotas de fondos de inversión y promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión, este ítem debe quedar en blanco."

- b. Sustitúyese el cuarto párrafo del código 96.22, por el siguiente:

"En el caso de acciones, cuotas de fondos de inversión y promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión, se informará el número de unidades que corresponda."

- c. Sustitúyese el código 96.23, por el siguiente:

"96.23 Precio Unitario

Se debe indicar el precio unitario, expresado en pesos y centavos, al cual el instrumento informado fue transado. Para el caso de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión se deberá informar el precio en pesos y centavos determinado en el contrato de promesa."

- d. Sustitúyese el código 96.25, por el siguiente:

"96.25 Compra/Venta

Se debe indicar

C: En caso de compra

L: En caso de acciones liberadas

P: En caso de ejercicio de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión.

¡Error! No se encuentra el origen de la referen

V: En caso de venta

R: En caso de vencimiento o rescate

S: En caso de sorteo"

- e. Sustitúyese el tercer párrafo del código 96.26, por el siguiente:

"Este ítem debe quedar en blanco toda vez que se informen las siguientes operaciones: compra o venta de acciones, cuotas de fondos de inversión, sorteos o rescates de instrumentos y compra o ejercicio de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión."

- f. Sustitúyese el segundo párrafo del código 96.27, por el siguiente:

"En caso de los instrumentos de tasa variable, operaciones de compra o venta de acciones, cuotas de fondos de inversión, sorteos o rescates de instrumentos y compra o ejercicio de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión, este ítem debe quedar en blanco."

- g. Sustitúyese el segundo párrafo del código 96.28, por el siguiente:

"Este ítem debe quedar en blanco toda vez que se informen las siguientes operaciones: compra o venta de acciones, cuotas de fondos de inversión, sorteos o rescates de instrumentos y compra o ejercicio de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión."

C. Modificaciones a la letra G.

Agrégase la siguiente letra e) al párrafo G.1, Instrucciones Generales:

"e) Cada vez que se ejerza una promesa de suscripción y pago de

¡Error! No se encuentra el origen de la referen

cuotas de fondos de inversión, se deberá efectuar un ingreso a la respectiva custodia por las unidades ejercidas, informando en la columna del código 96.11 los tipos de instrumentos CFI o CFK según corresponda".

D. Modificaciones a la letra I

En el párrafo I.1., agréguense los siguientes códigos de instrumentos, a continuación del código BCS: Bonos respaldados por títulos de crédito transferibles.

PFI: Promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión inmobiliarios. Este código sólo se utilizará en el formulario D-2.2.

PFK: Promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión de desarrollo de empresas. Este código sólo se utilizará en el formulario D-2.2.

II. VIGENCIA

Las normas establecidas en la presente Circular comenzarán a regir a contar del 1^o de Diciembre de 1995.

JULIO BUSTAMANTE
JERALDO
Superintendente de AFP

¡Error! No se encuentra el origen de la referen

SANTIAGO, 30 de OCTUBRE de 1995.

1.5 REQUERIMIENTOS DE ENCAJE

Monto en \$

- 591.20 Encaje Requerido
- 591.21 Encaje Mantenido
- 591.22 Superávit (Déficit) del Encaje

1.6 REQUERIMIENTOS DE CUSTODIA, CORTE DE CUPON Y DIVIDENDOS

Monto en \$

1.6.1 Custodia del Fondo de Pensiones

- 691.30 Ingreso de Documentos a Custodia
 - 691.30.10 Ingreso de Documentos a Custodia en el Banco Central
 - 691.30.20 Ingreso de Documentos a Custodia en el Extranjero
 - 691.30.30 Ingreso de Documentos a Custodia en el Depósito Central de Valores

- 691.31 Retiro de Documentos de Custodia
 - 691.31.10 Retiro de Documentos de Custodia del Banco Central
 - 691.31.20 Retiro de Documentos de Custodia en el Extranjero
 - 691.31.30 Retiro de Documentos de Custodia del Depósito Central de Valores

- 691.32 Custodia Mantenido
 - 691.32.10 Custodia Mantenido en el Banco Central
 - 691.32.20 Custodia Mantenido en el Extranjero
 - 691.32.30 Custodia Mantenido en el Depósito Central de Valores

- 691.33 Custodia Requerida
 - 691.33.10 Custodia Requerida en el Banco Central y/o en D.C.V.
 - 691.33.20 Custodia Requerida en el Extranjero

- 691.34 Superávit (Déficit) de Custodia
 - 691.34.10 Superávit (Déficit) de Custodia en el Banco Central y/o en D.C.V.
 - 691.34.20 (Déficit) de Custodia en el Extranjero

1.6.2. Cortes de Cupón y Dividendos

- 691.40 Corte cupón Fondo
 - 691.40.10 Financieros
 - 691.40.11 Estatales
 - 691.40.12 Extranjeros

691.41 Dividendos Fondo

691.50 Corte de Cupón Reserva de Prima

1.7 CUENTAS DE ORDEN

Monto en \$

1.7.1 Orden - Debe

- 791.10 Derechos por contratos de futuros nacionales
- 791.20 Derechos por contratos de futuros extranjeros
- 791.30 Derechos por títulos nacionales entregados en garantía
- 791.40 Derechos por títulos extranjeros entregados en garantía
- 791.50 Derechos por monedas extranjeras entregadas en garantía
- 791.60 Derechos por contratos de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión inmobiliarios
- 791.70 Derechos por contratos de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión de desarrollo de empresas

1.7.2 Orden - Haber

- 792.10 Obligaciones por contratos de futuros nacionales
- 792.20 Obligaciones por contratos de futuros extranjeros
- 792.30 Obligaciones por títulos nacionales entregados en garantía
- 792.40 Obligaciones por títulos extranjeros entregados en garantía
- 792.50 Obligaciones por monedas extranjeras entregadas en garantía
- 792.60 Obligaciones por contratos de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión inmobiliarios
- 792.70 Obligaciones por contratos de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión de desarrollo de empresas

Nombre: _____

Firma Gerente General

El suscrito, en mi calidad de Gerente General de la Administradora de Fondos de Pensiones _____, me declaro responsable de la información contenida en este Informe Diario. Asimismo, declaro que esta información es igual a la que se envía en la transmisión electrónica de datos o cinta magnética.

¡Error! No se encuentra el origen de la referen

**SUPERINTENDENCIA DE ADMINISTRADORAS
DE FONDOS DE PENSIONES**

ANEXO N°1

FORMULARIO D-2.2

MOVIMIENTOS DIARIOS DE LA CARTERA DEL FONDO
INSTRUMENTOS EMITIDOS EN SERIE Y ACCIONES

Nombre de la A.F.P. _____
 R.U.T. _____
 Fecha (AA-MM-DD) _____
 Hoja Número _____
 Líneas informadas _____
 Total Control _____

96.11 Tipo de Instrumento	96.12 RUT del Emisor	96.13 Serie del Instrumento	96.14 Fecha de Emisión (AA-MM-DD)	96.22 Unidades	96.23 Precio Unitario	96.24 Valor Total	96.25 Compra (*) Venta (**)	96.26 TIR o % Valor Par (en %)	96.27 Tasa Nominal de Emisión (en %)	96.28 Plazo del instrumento (años)	96.30 Código de Transacción
1											
2											
3											
4											
5											
6											
7											
8											
9											
10											
11											
12											

Nota Informar primero las compras, luego las ventas.

- * Diferenciar las compras en:
- C: Compras de instrumentos
 - L: Acciones liberadas
 - P: Ejercicio de promesas de suscripción y pago de cuotas de fondos de inversión
- ** Diferenciar las ventas en:
- V: Ventas de instrumentos
 - R: Rescate de instrumentos
 - S: Instrumentos seriados

¡Error! No se encuentra el origen de la referen

Anexo N° 2: Descripción de códigos empleados en los Informes Diarios