

**SUPERINTENDENCIA DE ADMINISTRADORAS
DE FONDOS DE PENSIONES**

CIRCULAR N° 931

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 N° 855.

I. De la Información

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 cierre del último día hábil de cada mes.

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

3. La citada información deberá estar dispuesta, tanto para el caso de la transmisión de datos como el de diskette, de acuerdo a las especificaciones impartidas en el anexo "Instrucciones de información mensual de la cartera de inversión", que se adjunta a esta Circular.
4. La información mensual de la cartera de inversiones deberá transmitirse antes de las 16 horas 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 a transmitir deberá estar dispuesta en un registro que se compondrá de 11 campos. El orden y el contenido de cada uno de ellos será el siguiente:

- Primer Campo: Tipo de Custodio.

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

- 0 Cuando el instrumento se encuentre en Custodia Local
- 1 Cuando el instrumento se encuentre en el Depósito Central de Valores
- 2 Cuando el instrumento se encuentre en el Banco Central de Chile
- T Cuando se informe el total de la cartera sin hacer distinción por custodio

En el caso de la transmisión mensual de la cartera de inversiones que se debe realizar el primer día de cada mes, se deberá informar en este campo el código T, salvo que esta Superintendencia solicite expresamente lo contrario.

En el caso que esta Superintendencia solicite informar la cartera de inversiones separada por custodio, en este campo se deberán informar los códigos 0, 1 y 2, de acuerdo a la custodia en la cual se encuentren los instrumentos al cierre de la fecha para la cual se solicitó la información.

Asimismo, esta Superintendencia podrá solicitar la transmisión de todos los instrumentos de la cartera del Fondo de Pensiones que pertenecen sólo a un custodio específico.

- Segundo Campo: Tipo de instrumento

Se debe indicar la abreviatura correspondiente al tipo de instrumento que se informa. Para ello deberá utilizarse el CODIGO DE INSTRUMENTOS que aparece señalado en la letra G de la Circular No. 478 de esta Superintendencia.

- Tercer Campo: Instrumento Objeto

Se deberá indicar el instrumento objeto para el caso de contratos de opciones, futuros y forwards de tasas de interés y bonos emitidos en el extranjero, de acuerdo a lo señalado en la

Circular N° 478 de esta Superintendencia.

Para el resto de los instrumentos este campo deberá quedar en blanco.

- Cuarto Campo: RUT del emisor

Se deberá indicar el RUT del emisor, si se trata de emisores nacionales, o el Código del emisor, si se trata de emisores extranjeros.

- Quinto Campo: Serie del Documento

Se deberá indicar la serie del documento de acuerdo a lo indicado en la Circular N° 478 de esta Superintendencia.

- Sexto Campo: Precio de Ejercicio o del Contrato

Para el caso de contratos de opciones, tanto nacionales como extranjeras, se deberá indicar el precio de ejercicio, expresado con seis decimales.

Para el caso de futuros y forwards, tanto nacionales como extranjeros, se deberá indicar el precio del contrato expresado con seis decimales.

Para el resto de los instrumentos este campo deberá quedar en blanco.

- Séptimo Campo: Fecha de emisión

Corresponde a la fecha en la cual fue emitido el instrumento. Esta deberá estar expresada en la forma AAMMDD.

Para el caso de instrumentos de intermediación financiera, instrumentos de renta variable e instrumentos derivados, este ítem deberá quedar en blanco.

- Octavo Campo: Fecha de Vencimiento

Es la fecha de vencimiento del instrumento, la cual se expresará en la forma AAMMDD. Para el caso de instrumentos de renta variable, este ítem deberá quedar en blanco.

- Noveno Campo: Unidades

Se deberá indicar el 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 de intermediación financiera se informará el valor final del instrumento 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 N° 478 de esta Superintendencia.

- Décimo Campo: Precio Unitario

Se deberá indicar el precio unitario, expresado en pesos y centavos, al cual el instrumento está valorado. Para el caso de contratos a futuro este campo deberá quedar en blanco.

- Undécimo Campo: Valor Total

Se deberá indicar el valor total expresado en pesos, de las unidades informadas por cada instrumento, sin decimales. Para el caso de contratos a futuro este campo deberá quedar en blanco.

II. Vigencia

Las normas establecidas en la presente Circular comenzarán a regir a partir del 1° de Julio de 1996.

JULIO BUSTAMANTE JERALDO
Superintendente de AFP

SANTIAGO, 29 de MAYO de 1966.

Instrucciones para la recepción de la cartera de inversiones de las A.F.P.

El envío de la cartera de inversiones deberá realizarse a través de transmisión electrónica a los equipos computacionales de la Superintendencia de A.F.P. y sólo ante una autorización de esta Superintendencia podrá recurrirse a un diskette de 3½ pulgadas de alta densidad (en formato DOS), el que tendrá que ser identificado con una etiqueta que contenga el nombre de la A.F.P., la frase "Cartera de instrumentos" y la fecha que corresponde la información.

Las especificaciones y modalidades de transmisión, así como también el nombre del archivo a enviar vía transmisión o en diskette, se encuentran definidas en la Circular N° 807.

Descripción del registro

Tipo de custodio	X(01)
Tipo de instrumento	X(03)
Filler	X(01)
Instrumento objeto	X(16)
Nacionalidad	X(01)
R. U. T. del emisor	X(09)
Serie del documento	X(16)
Precio de ejercicio o contrato	9(12)V9(06)
Fecha de emisión	9(06)
Fecha de vencimiento	9(06)
Unidades	9(12)V9(02)
Precio unitario	9(12)V9(06)
Valor total	<u>9(14)</u>
Total	X(123)

Notas:

- Las fechas deben ser expresadas de la forma aammdd, donde aa es el año, mm es el mes y dd es el día.
- En el campo filler se debe informar un blanco.
- Los campos tipo X deben estar alineados a la izquierda, completando su tamaño con blancos.
- Los campos tipo 9 deben estar alineados a la derecha, completando su tamaño con ceros.