

## Libro IV, Título VIII, Capítulo IV Instrucciones para llenar los Formularios Electrónicos del Informe Diario

# Ñ. Instrucciones para llenar Formularios de Excesos y Déficit de Inversión Diarios por Operaciones con Instrumentos Derivados

---

### Ñ1. INSTRUCCIONES PARA LLENAR EL FORMULARIO D-2.14.1 EXCESOS DE INVERSIÓN DIARIOS POR OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS

**Nota de actualización:** El texto de este título fue modificado por la Norma de Carácter General Nº 138, de fecha 11 de marzo de 2015.

#### 1. INSTRUCCIONES GENERALES.

a) En el encabezamiento de cada formulario deberá indicarse lo siguiente:

i. Nombre de la AFP: El que corresponda.

ii. R.U.T.: El de la Administradora.

iii. Fondo Tipo: Se indicará el carácter que identifique el Tipo de Fondo que se esté informando.

**Nota de actualización:** Este literal fue incorporado por la Norma de Carácter General Nº 138, de fecha 11 de marzo de 2015, pasando los originales iii al vi, a ser iv al vii, respectivamente.

iv. Fecha: Se debe indicar en el formato AAAA-MM-DD.

v. Hoja número: Las hojas que se utilicen para llenar este formulario deben estar numeradas en forma ascendente comenzando por el número 1.

vi. Líneas informadas: Se debe indicar la cantidad de líneas informadas en cada hoja. En todo caso, el número máximo de líneas informadas no podrá exceder de 99.

vii. Total Control: Corresponde al total en pesos de las cantidades informadas en la columna "Monto de exceso de inversión en \$".

b) Cuando en la columna "Excesos a informar" se informen los códigos SDC (Subtotal derivados de cobertura) y SPNV (Subtotal Posición neta vendedora), sólo se deberá presentar información en los campos "Monto de exceso de inversión en \$" y "% respecto del valor del Fondo de Pensiones".

#### 2. INSTRUCCIONES ESPECÍFICAS.

Columnas:

Cada columna debe ser completada de acuerdo a las siguientes indicaciones:

a) Excesos a informar: corresponde informar el código que identifica el tipo de exceso de inversión por operaciones con instrumentos derivados, los cuales deben ser desglosados en las siguientes categorías:

- DC: Derivados de cobertura, corresponde informar los excesos de inversión por operaciones de cobertura.

- SDC: Subtotal derivados de cobertura, corresponde a la suma de los excesos de cobertura de las monedas individuales.

- DI: Derivados de Inversión, corresponde informar los excesos de inversión por operaciones de derivados de inversión.

- PNV: Posición neta vendedora (directa más indirecta), corresponde informar los excesos provenientes de la prohibición a las Administradoras, de manera directa e indirecta, de tomar posiciones netas vendedoras de un activo objeto en derivados de inversión, que sumadas a las posiciones netas vendedoras de ese mismo activo objeto en derivados de cobertura, superen la inversión contado en el activo objeto.

- SPNV: Subtotal Posición neta vendedora, corresponde a la suma de los excesos de posiciones netas vendedoras de las monedas individuales.

b) Activo Objeto: tratándose de exceso de cobertura cambiaria, corresponderá informar el código identificador de la moneda respectiva. Este campo no deberá ser completado para el exceso proveniente de derivados de inversión.

Se deberán agregar tantas líneas como activos objeto (monedas) estén en situación de exceso.

c) Monto de exceso de inversión en \$: corresponde al monto de exceso de inversión en pesos a la fecha informada. En el caso de derivados de monedas, se calcula a partir de las unidades de la moneda objeto en exceso transformadas a pesos, al tipo de cambio vigente en el día.

d) % respecto del valor del Fondo de Pensiones: corresponde al porcentaje del exceso de inversión respecto del valor del Fondo de Pensiones a la fecha informada.

e) Fecha de origen del exceso: corresponde a la fecha en que se originó el exceso de inversión.

f) Fecha de expiración plazo de regularización: corresponde a la fecha en que, según el plazo máximo normativo, se debe regularizar el exceso de inversión.

## **Ñ2. INSTRUCCIONES PARA LLENAR EL FORMULARIO D-2.14.2 DE DÉFICIT DE INVERSIÓN DIARIOS POR OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS**

**Nota de actualización: El texto de este título fue modificado por la Norma de Carácter General Nº 138, de fecha 11 de marzo de 2015.**

### **1. INSTRUCCIONES GENERALES.**

En el encabezamiento de cada formulario deberá indicarse lo siguiente:

i. Nombre de la AFP: El que corresponda.

ii. R.U.T.: El de la Administradora.

iii. Fondo Tipo: Se indicará el carácter que identifique el Tipo de Fondo que se esté informando.

**Nota de actualización: Este literal fue incorporado por la Norma de Carácter General Nº 138, de fecha 11 de marzo de 2015, pasando los originales iii al vi, a ser iv al vii, respectivamente.**

iv. Fecha: Se debe indicar en el formato AAAA-MM-DD.

v. Hoja número: Las hojas que se utilicen para llenar este formulario deben estar numeradas en forma ascendente comenzando por el número 1.

vi. Líneas informadas: Se debe indicar la cantidad de líneas informadas en cada hoja. En todo caso, el número máximo de líneas informadas no podrá exceder de 99.

vii. Total Control: Corresponde al total en pesos de las cantidades informadas en la columna "Monto de déficit de inversión en \$".

### **2. INSTRUCCIONES ESPECÍFICAS.**

Columnas:

Cada columna debe ser completada de acuerdo a las siguientes indicaciones:

a) Activo Objeto: corresponde al activo objeto al cual corresponde el determinado déficit. Tratándose de déficit de cobertura cambiaria, corresponderá al código identificador de la moneda respectiva.

Se deberán agregar tantas líneas como activos objeto (monedas) estén en la situación de déficit.

b) Monto de déficit de inversión en \$: corresponde al monto de déficit de inversión en pesos a la fecha informada. Se calcula a partir de las unidades de la moneda objeto en déficit transformadas a pesos.

c) % respecto del valor del Fondo de Pensiones: corresponde al porcentaje del déficit de inversión respecto del valor del Fondo de Pensiones a la fecha informada.

d) Fecha de origen del déficit: corresponde a la fecha en que se originó el déficit de inversión.

e) Fecha de expiración plazo de regularización: corresponde a la fecha en que, según el plazo máximo normativo, se debe regularizar el déficit de inversión.

**Nota de actualización: Esta letra fue incorporada por la Norma de Carácter General N° 98, de fecha 16 de diciembre de 2013.**