

**Libro IV, Título II, Letra D Norma de Información, Anexos**

# **Anexo N° 4 Informe Mensual de Cotizaciones de Precios de Notas Estructuradas**

---

## Anexo N° 4

### Informe mensual de cotizaciones de precios de notas estructuradas

#### 4.1 Los campos a ser completados son:

Nombre del emisor	: Nombre del emisor de la nota estructurada. Largo máximo de 30 caracteres.
Fuente Información	: Se deberá informar, BLOOMBERG o REUTERS.
Nemotécnico	: Código nemotécnico con el cual el instrumento se identifica en los sistemas. En el caso de Bloomberg, será el <i>Ticker Symbol</i> y en el caso de Reuters el <i>RIC</i> . Se deben informar ambos códigos en caso que se difunda en los dos sistemas de información.
Serie Instrumento	: Código oficial que identifica de manera única el instrumento (ISIN, CUSIP u otro determinado por esta Superintendencia) informado en el campo Serie del Instrumento en el Informe Diario. Largo máximo de 12 caracteres alfanuméricos.
Contribuidor de Precio	: Nombre de la firma que difunde los precios y que preparó el informe. Largo máximo de 30 caracteres.
Fecha de Valoración	: Fecha para la que corresponde la valoración, en formato AAAAMMDD.
Precio Bid	: Precio de compra o "Bid Price", número entero con dos decimales.
Precio Offer	: Precio de venta u "Offer Price", número entero con dos decimales.
Spread	: Diferencial entre precios Bid y Offer, expresado en puntos porcentuales, número entero con dos decimales.
Activo subyacente	: Activo/s que genera/n el retorno variable de la nota. Se debe individualizar con su código ISIN u otro código internacional. Si hay más de un activo, separar por guión (-). Largo máximos de 30 caracteres alfanuméricos. Ejemplo, si son dos índices, SPX y NKY, se informará: SPX-NKY
Componente Renta Fija del Precio Bid	: Valor del componente de renta fija, para el precio de compra del contribuidor. Número entero con dos decimales.

- Componente Variable del Precio Bid** : Valor del componente variable al que está indexada la nota, para el precio de compra del contribuidor. Número entero con dos decimales.
- Tasa de interés de descuento renta variable** : Tasa de interés implícita empleada para valorar el componente/s renta variable de la nota. En caso de que el activo sea un conjunto de instrumentos o índices, se deberá informar cada uno, separados por un guión (-). Las cifras corresponderán a números enteros con dos decimales. ejemplo, en el caso que el activo esté compuesto por dos índices, se deberá informar, considerando el orden en que se informó los componentes en el campo Activo subyacente: 5,92-4,25.
- Tasa de interés de descuento renta fija** : Tasa de interés implícita empleada para valorar el componente de renta fija de la nota estructurada. Número entero con dos decimales.
- Volatilidad implícita** : Valor de la volatilidad implícita del activo subyacente empleada en el precio Bid. Valor expresado como un porcentaje anual e informado como número entero con dos decimales. Si el activo está compuesto por más de un instrumento, se deberá informar cada una, separadas por guiones y en el orden informado en el campo Activo subyacente.
- Periodo para volatilidad empleada** : Aquel empleado por el modelo de valoración utilizado por el contribuidor de precios. Número entero sin decimales, y largo máximo de 4.
- Dividend yield** : Tasa de rendimiento de dividendos que paga el activo subyacente. En caso que haya más de un instrumento, se deberán informar cada una separadas por un guión y en el orden informado en el campo Activo subyacente. Número entero con dos decimales.
- Otros** : Se deberá informar otras variables que en opinión del contribuidor de precios sean relevantes. Largo máximo de 30 caracteres.

#### 4.2 Formato del informe mensual de cotizaciones de precios de notas estructuradas

I. IDENTIFICACION DEL INSTRUMENTO	nota 1	nota 2	etc
NOMBRE DEL EMISOR			
FUENTE INFORMACION			
NEMOTECNICO			
SERIE INSTRUMENTO			
II. CARACTERISTICAS DE LA COTIZACION DE PRECIO			
CONTRIBUIDOR DE PRECIOS			
FECHA DE VALORACION			
PRECIO BID			
PRECIO OFFER			
SPREAD			
III. CARACTERISTICAS COMPONENTES			
ACTIVO SUBYACENTE			
COMPONENTE RENTA FIJA DEL PRECIO BID			
COMPONENTE VARIABLE DEL PRECIO BID			
TASA DE INTERES DE DESCUENTO			
VOLATILIDAD IMPLICITA			
PERIODO PARA VOLATILIDAD EMPLEADA			
DIVIDEND YIELD			
OTROS			

#### 4.3 Especificaciones técnicas para el envío vía transmisión de datos del Informe sobre cotizaciones de precios de notas estructuradas.

- 4.3.1 El envío de los informes debe realizarse de acuerdo con las especificaciones técnicas y modalidad de transmisión definidas en la Circular de transmisión de datos.

En el nombre del archivo a transmitir se identifica la A.F.P. y la fecha del informe, esto es:

aaaammdd      Corresponde a la fecha de cierre al que están referido el informe al que está referida la información.

ext              Corresponde a la abreviación de tres caracteres que identifica a la A.F.P.

#### 4.3.2 Informe mensual de cotizaciones de precios de notas estructuradas

Archivo: