

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

N. Instrucciones para llenar el Formulario D-2.13: Transacciones de nuevos instrumentos de la cartera de inversiones del Fondo de Pensiones: nuevos fondos mutuos y de inversión nacionales y promesas de suscripción de cuotas de fondos de inversión nacionales

Se entenderá por nuevo instrumento aquél que no se encuentre en la transmisión de precios que envía esta Superintendencia a las Administradoras, correspondiente al día hábil anterior a la fecha de adquisición o transacción.

El concepto de nuevo instrumento comprende también a aquéllos que experimenten cambios en el código nemotécnico, debido a que en tal caso no se encontrarán en la transmisión de precios que remite esta Superintendencia a las Administradoras. En consecuencia, si con ocasión de algún evento se produce un cambio en el nemotécnico que identifica al fondo mantenido en cartera por algún Fondo de Pensiones, ésta deberá informar a esta Superintendencia a más tardar el día hábil siguiente de ocurrido el cambio mediante este Formulario. Dicho informe deberá indicar el nemotécnico que es reemplazado, el nuevo nemotécnico y la fecha del cambio, según corresponda.

1. INSTRUCCIONES GENERALES.

a) El encabezado de cada hoja de este formulario debe ser llenado siguiendo las mismas instrucciones señaladas en el número 1 de la letra B de este Capítulo, con la excepción del campo "Total control".

b) Este formulario se completará por filas, en lugar de columnas. Cada instrumento se informará en una o en un conjunto de columnas.

c) Los instrumentos que se informen en este formulario deberán ordenarse por fecha de adquisición o de transacción.

d) Los nuevos instrumentos serán informados en el Informe Diario correspondiente al día de la transacción.

e) Los nuevos fondos mutuos, de inversión y promesas de suscripción nacionales que recién inician operaciones y no tienen estados financieros, deberán clasificar la fila Tipo de Activos de acuerdo a lo establecido en su reglamento o prospecto.

f) Asimismo, en el caso de nuevos fondos mutuos, de inversión y promesas de suscripción de cuotas de fondos de inversión nacionales que recién inician operaciones, no deben informarse las filas: Porcentaje de inversión en el extranjero, Fecha de los estados financieros e Inversión por país.

2. INSTRUCCIONES ESPECÍFICAS.

Cada fila deberá ser completada de acuerdo a las siguientes indicaciones:

Filas:

Identificación del Instrumento

a) Tipo de instrumento

Se debe indicar la abreviatura correspondiente al tipo de instrumento que se informa. Para ello deberá utilizarse el CÓDIGO DE INSTRUMENTOS que aparece señalado en el Capítulo VI del presente Título.

b) Nombre del emisor

Nombre o razón social de la administradora del fondo mutuo o fondo de inversión, según corresponda.

c) RUT del emisor

RUT de la administradora del fondo mutuo o fondo de inversión, según corresponda.

d) Nombre del fondo

Nombre completo con que se encuentra inscrito el fondo en la Superintendencia de Valores y Seguros.

e) Nemetécnico del fondo

Se debe indicar el nemotécnico definido o autorizado por la Superintendencia de Valores y Seguros, para los fondos mutuos y de inversión nacionales.

f) Código Bloomberg o Reuters

Código nemotécnico con el cual el instrumento se identifica en los sistemas oficiales de información. En el caso de Bloomberg, será el Ticker symbol y en el caso de Reuters el RIC, si corresponde.

g) Moneda de denominación

Moneda en la que se ha emitido el instrumento adquirido.

h) Porcentaje de inversión en el extranjero

Corresponde al porcentaje del total de los activos del fondo mutuo y de inversión que se encuentra invertido en instrumentos extranjeros.

Características del fondo

i) Holding Company

Nombre abreviado del administrador del fondo mutuo o de inversión, registrado en la tabla Holding Company, disponible en el sitio web de la Superintendencia de Pensiones: <http://www.spensiones.cl/xml>.

j) Tipos de fondos de inversión

Se deberá señalar la clasificación del fondo de inversión de acuerdo a su tipo, esto es si es un fondo: Mobiliario (MO), Inmobiliario (IM), Capital Privado (CP) u Otros (OT). La información deberá ser obtenida desde el sitio web de la Superintendencia de Valores y Seguros.

k) Tipo de activos

Se deberá señalar la categoría en cuanto a activos del fondo. Esto es, si corresponden a: Accionario (AC), Bonos (BO), Balanceado (BA), Liquidez (EF) u Otros (OT).

l) Fecha de los estados financieros

Se deberá señalar la fecha de cierre de los Estados Financieros del ejercicio más reciente de los cuales corresponde la información. Para aquellos casos que no se dispongan de Estados Financieros, se considerará la fecha de la cartera de inversión utilizada.

m) Clase de Activos

Se deberá indicar la categoría en cuanto a activos del fondo. Esto es, si corresponde a capital privado (CP) o deuda privada (DP). Este campo sólo aplica para fondos nacionales que tengan como subyacentes activos alternativos.

Nota de actualización: Esta letra fue incorporada por la Norma de Carácter General N° 208, de fecha 25 de octubre de 2017.

n) Estrategia

Se deberá indicar alguna de las siguientes categorías:

Balanced Buyout Direct lending Distressed debt Fund of funds Growth Infrastructure Mezzanine Real estate Venture capital Otra

Este campo sólo aplica para fondos nacionales que tengan como subyacentes activos alternativos extranjeros.

Nota de actualización: Esta letra fue incorporada por la Norma de Carácter General N° 208, de fecha 25 de octubre de 2017.

o) Vintage

Se deberá informar el año (AAAA) en que se efectuó la primera inversión del vehículo (sólo para vehículos que hayan realizado inversiones). Este campo sólo aplica para fondos nacionales que tengan como subyacentes activos alternativos extranjeros.

Nota de actualización: Esta letra fue incorporada por la Norma de Carácter General N° 208, de fecha 25 de octubre de 2017.

p) Fecha de vencimiento

Se deberá Indicar la fecha de vencimiento del fondo en formato AAAA-MM-DD.

Nota de actualización: Esta letra fue incorporada por la Norma de Carácter General N° 208, de fecha 25 de octubre de 2017.

q) Porcentaje de inversión en activos alternativos

Se deberá informar una cifra expresada en porcentaje con dos decimales. En caso de corresponder a promesas de suscripción de fondos de inversión que aún no han materializado sus inversiones y cuyo reglamento interno señale que se invertirá preferentemente en activos alternativos, se deberá informar un 100,00%.

Nota de actualización: Esta letra fue incorporada por la Norma de Carácter General N° 208, de fecha 25 de octubre de 2017.

Característica de la transacción

r) Fecha de la transacción

Es la fecha en la cual se realizó la transacción. Se debe indicar en el formato AAAA-MM-DD.

s) Fecha de perfeccionamiento

Es la fecha en la cual se perfeccionó la transacción. Se debe indicar en el formato AAAA-MM-DD.

t) Unidades

Unidades del instrumento que se transó. Se informará con cuatro decimales.

u) Precio unitario en pesos

Se debe indicar el precio unitario expresado en pesos y centavos, al cual fue transado el instrumento.

v) Monto pagado en pesos

Se debe indicar el valor total, expresado en pesos, de las unidades informadas por cada transacción.

w) Inversión por país

Las siguientes filas contienen países, en donde deberá informarse el porcentaje invertido en cada uno de éstos por el fondo mutuo o de inversión nacional, siendo la fuente oficial de información los estados financieros correspondientes a la fecha informada en el campo "Fecha Estado Financiero". De no contener dichos estados financieros la información sobre la distribución geográfica de las inversiones, se puede usar otro documento oficial del emisor que haga referencia a la misma fecha de los referidos estados financieros. La inversión en instrumentos derivados se debe asignar al país correspondiente al emisor del instrumento derivado. Si la inversión en instrumentos de renta fija o "money market", y/o saldos disponibles no supera el 5% de las inversiones del fondo, ésta podrá ser informada en la fila correspondiente al país "Otros" (OT). En caso contrario, deberá clasificarse según el correspondiente país. Si las inversiones de un fondo de inversión superan a los activos netos, producto de apalancamiento o "leverage", éstas deberán ajustarse al 100% de los activos netos, distribuyendo la inversión en cada país de manera proporcional a la distribución geográfica original. Por lo tanto, el informe no podrá contener países con porcentajes negativos.

Las cifras corresponderán a números enteros con dos decimales. Para informar los países se deberán utilizar los mismos códigos de países establecidos para la inversión por país del formulario D-2.9. Se dejará en cero los países sin inversión y la suma total debe ser igual a 100. La fila "Otros" (OT) deberá emplearse en caso de no aplicar ninguno de los países listados.

En el caso de activos alternativos, se deberá informar este campo cuando se informe un aporte inicial, así como en el caso de inversiones en el mercado secundario. En otro caso, este campo no deberá informarse.

Nota de actualización: Este párrafo fue incorporado por la Norma de Carácter General N° 208, de fecha 25 de octubre de 2017.

Nota de actualización: Esta Letra N fue reemplazada por la Norma de Carácter General N° 138, de fecha 11 de marzo de 2015.