

FICHA TÉCNICA NCG N°571

CARTERA PROPIA DE INTERMEDIARIOS

La presente ficha técnica establece las instrucciones y procedimientos que deberán seguir los intermediarios para reportar lo dispuesto en la sección XI.C del Capítulo 3 de la Norma de Carácter General N°571 referente a sus instrumentos de cartera propia.

I. REPORTE DE CARTERA PROPIA DE INTERMEDIARIOS.

Para el reporte de cartera propia, cada intermediario de valores deberá ingresar a CMF Supervisa, a través de un usuario habilitado y acceder al módulo "Reporte de cartera propia de intermediarios de valores". Este módulo incluye las siguientes opciones:

- Manual de usuario.
- Validación Archivo o Envío sin Información.
- Envío y Listados de Validación.
- Solicitud de Reenvío

El intermediario deberá remitir dentro de los primeros cinco días hábiles de cada mes, los instrumentos de cartera propia referida al cierre del mes anterior. La cartera deberá contener la individualización de cada uno de los instrumentos que la componen, en los términos especificados en la Sección III siguiente.

La información objeto de la circular de envío de cartera propia podrá ser requerida por la Comisión a una fecha distinta al cierre del mes, por lo que los intermediarios de valores deberán contar con los sistemas que permitan su oportuno envío en todo momento, por medio de la opción de CMF Supervisa dispuesta para ello.

En caso de que el intermediario no disponga de instrumentos en cartera propia para el período en cuestión, deberá indicarlo en la opción "Validación Archivo o Envío sin Información". Se requerirá de la autorización de esta Comisión para modificar la cartera una vez remitida por parte del intermediario. Esto deberá ser solicitado expresamente por el intermediario mediante la opción "Solicitud de Reenvío". En su solicitud de reenvío, el usuario deberá indicar el periodo de la información a reenviar, el tipo de reenvío, es decir, si se responde a una solicitud efectuada por la Comisión o si es un reenvío voluntario, además del nombre del archivo el motivo por el cual lo está reenviando.

II. REVISIÓN Y CONFORMIDAD POR PARTE DE LA COMISIÓN.

Los listados de errores y advertencias pueden ser revisados por el intermediario en la opción "Envío y Listados de Validación" en la cual, las entidades podrán verificar tanto las validaciones físicas como las validaciones lógicas que deberán corregir para poder remitir la cartera de inversiones en caso de que corresponda.

Si la cartera presenta errores, los intermediarios tendrán la obligación de corregirla, previo a su envío a la Comisión, dentro del plazo de envío (cinco primeros días hábiles de cada mes o el plazo indicado en caso que el requerimiento se haga a una fecha distinta del cierre de mes). La cartera no será aceptada mientras el intermediario no subsane todos los errores identificados y comunicados por la Comisión. Una vez que el intermediario valide el archivo, deberá remitir el archivo por medio de la opción de "Envío y Listado de Validación", botón "Enviar Información".

III. INDIVIDUALIZACIÓN DEL ARCHIVO Y ESTRUCTURA DE LOS REGISTROS.

1. Individualización del archivo.

El nombre del archivo deberá ser exclusivamente el indicado, donde “aaaa” corresponde al año, “mm” al mes y “dd” al día del período que se está informando. Si el año, mes o día es inferior a 10 en números árabes, se debe anteponer 0 (cero). Todos los tipos de registro del archivo deben tener el mismo largo, cualquiera sea la estructura.

DESCRIPCION	NOMBRE
Archivo Cartera propia	IVCRaaaammdd.TXT

2. Tipo de registro.

El archivo IVCRaaaammdd.TXT deberá contener la siguiente estructura:

Identificación (registro tipo 1)	Contiene información que permita identificar al intermediario de valores que informa y el día de la información. Cabe señalar que solo se debe informar un registro de este tipo y deberá ser el primero del archivo.
Detalle (registro tipo 2)	Contendrá información de la cartera propia del intermediario de valores. Se deberá informar un registro por cada instrumento.
Totales (registro de tipo 3)	Contendrá información de cuadratura de los registros de detalle informados. Cabe señalar que solo se deberá informar un registro de este tipo y deberá ser el último del archivo.

3. Requerimiento de información de instrumentos.

En caso de que el campo cuente con una longitud menor a la especificada en este requerimiento, se deberá completar con caracteres de espacio al final para aquellos campos cuyo formato sea alfanumérico, o anteponer ceros para los campos de formato numérico, para completar de este modo la longitud solicitada en el campo en cuestión. En caso de números decimales, se deberá completar con ceros al final del campo. También se deberá seguir este criterio en caso de que no se cuente con información para el campo, para lo cual se deberá completar con espacios o ceros según la longitud del campo. Los valores numéricos deberán informarse sin separadores de miles ni decimales. Las letras ñ y Ñ deben reemplazarse por #, las palabras no deben ir acentuadas y no se debe incluir símbolos especiales, tales como “°”, entre otros. Luego, por ejemplo, “Compañía N° 393”, debería grabarse como “Compa#ia N 393”. Las fechas deberán informarse de acuerdo con el formato dispuesto en la descripción del campo respectivo.

Registro Tipo 1

1. Tipo.....	9(01)
2. RUT.....	9(09)
3. Dígito verificador.....	X(01)
4. Período.....	9(08)
5. Razón social.....	X(100)
6. Filler.....	X(328)
Largo del registro 447Bytes	

1. Tipo

448

Tipo de registro. Registrar:

- 1

2. RUT

Rol Único Tributario del Intermediario que informa. Es obligatorio y no puede informarse en cero.

3. Dígito verificador

Dígito verificador del RUT del intermediario. Es obligatorio y no puede informarse en blanco.

4. Período

Período informado en formato AAAAMMDD

5. Razón social

Razón Social del Intermediario que informa

6. Filler

Se deberá informar espacios

Registro de tipo 2, de detalle

1. Tipo	9(01)
2. Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera ...	9(06)
3. Nemotécnico del instrumento	X(50)
4. Código ISIN o CUSIP	X(12)
5. Situación del instrumento	X(02)
6. Rut del emisor o fondo	9(09)
7. Dígito verificador	X(01)
8. Nombre del emisor o administrador	X(100)
9. Código país emisor	X(02)
10. Tipo de instrumento	X(10)
11. Fecha de vencimiento	X(10)
12. Clasificación de riesgo	X(03)
13. Tendencia clasificación de riesgo	X(50)
14. Cantidad de unidades	9(15)V9(4)
15. Moneda	X(3)
16. TIR, valor par o precio	-9(15)V9(4)
17. Código de valorización	X(02)
18. Base tasa.....	9(03)
19. Valorización al cierre.....	-9(15)V9(4)
20. Código país de emisión del instrumento.....	X(02)
21. Relacionado.....	X(02)
22. Fuente precios.....	X(100)
23. Duración.....	-9(15)V9(4)

Largo del registro 447 bytes

1. Tipo

Tipo de registro. Registrar:

- 2

2. Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera

Se deberá indicar el código de la cuenta del Estado de Situación Financiera en que se encuentra registrado el instrumento que se informa, de acuerdo con la siguiente codificación¹:

- **110211:** Instrumentos financieros disponibles a valor razonable – renta variable
- **110212:** Instrumentos financieros disponibles a valor razonable – renta fija e intermediación financiera
- **110221:** Instrumentos financieros comprometidos a valor razonable – renta variable
- **110222:** Instrumentos financieros comprometidos a valor razonable – renta fija e intermediación financiera
- **110240:** Instrumentos financieros disponibles a costo amortizado
- **110250:** Instrumentos financieros comprometidos a costo amortizado

3. Nemotécnico del instrumento

Se deberá informar el código nemotécnico establecido por esta Comisión, en la Circular N°1.085, de 1982, o la que la reemplace. Para el caso de instrumentos extranjeros, se debe incluir el nemotécnico del instrumento en su país de origen. En caso de que el instrumento corresponda a un fondo sin nemotécnico, deberá informar nombre del fondo según su reglamento interno.

4. Código ISIN o CUSIP

Se deberá indicar el código ISIN (International Securities Identification Number) del instrumento o en caso de no contar con éste, el código CUSIP (Committee on Uniform Securities Identification Procedures). En caso de que no se disponga de un valor para este campo, completar con 12 caracteres de espacio en blanco.

5. Situación del instrumento

Indicar el código, según si la inversión se encuentra o no sujeta a restricciones, de acuerdo con la siguiente codificación:

- **NR:** Instrumento no sujeto a restricciones.
- **OP:** Instrumento sujeto a una operación a plazo (incluye simultáneas y pactos).
- **GT:** Instrumento entregado en garantía.
- **PR:** Instrumento entregado en préstamo.
- **OR:** Instrumento sujeto a otras restricciones

6. Rut del emisor o fondo

Indicar el RUT del emisor del instrumento financiero de propiedad del intermediario de valores. Si se tratara de inversiones en cuotas de fondos de inversión o de fondos mutuos nacionales, se deberá informar el RUN asignado por esta Comisión, el cual se encuentra disponible para consulta en el sitio Web www.cmfchile.cl. En el caso de emisores extranjeros completar con ceros. El formato deberá ser sin puntos ni guion, ni dígito verificador.

7. Dígito verificador

Señalar el dígito verificador del RUT del emisor o fondo, informado en el campo anterior. En el caso de instrumentos extranjeros completar con la letra "E".

8. Nombre del emisor o administrador

Indicar razón social del emisor del instrumento. En el caso de cuotas de fondo incorporar la razón social de la administradora correspondiente.

9. Código país emisor

Indicar el código del país del emisor del instrumento, de acuerdo con la codificación definida por esta Comisión, la cual se encuentra disponible para consulta en el Módulo SEIL del sitio Web www.cmfchile.cl.

10. Tipo de instrumento

Indicar el tipo de instrumento que mantiene el intermediario de valores, de acuerdo con la codificación definida por esta Comisión, la cual se encuentra disponible para consulta en el Módulo SEIL del sitio Web www.cmfchile.cl.

11. Fecha de vencimiento

En los casos que corresponda, indicar la fecha de vencimiento del instrumento mantenido en cartera por el intermediario de valores. Esta corresponderá a la fecha en que se producirá el pago final o el último flujo del título. Se deberá considerar para ello el formato de fecha DD-MM-AAAA. En caso de que no se disponga de un valor para este campo, completar con 10 caracteres de espacio en blanco (por ejemplo, para los casos de instrumentos de renta variable). Para el caso de bonos perpetuos, se deberá incluir como fecha de vencimiento el 01-01-9999.

12. Clasificación de riesgo

Indicar, cuando corresponda, la categoría de riesgo de los instrumentos, considerando para ello la menor categoría de riesgo de las clasificaciones efectuadas por las entidades clasificadoras de riesgo. Para estos efectos, se debe utilizar la denominación indicada en el artículo 88 de la Ley N° 18.045, esto es AAA, AA, A, BBB, BB, B C, D, y E, si se trata de títulos de deuda de largo plazo y N-1, N-2, N-3, N-4 y N-5, si se trata de títulos de deuda de corto plazo. En caso de que no se disponga de un valor para este campo, completar con 3 caracteres de espacio en blanco.

13. Tendencia clasificación de riesgo

Tipo de tendencia de la clasificación de riesgo considerada en el campo N°12, según la terminología ocupada por la clasificadora. Por ejemplo: Positiva, negativa, en observación, estable, etc. En caso de que no se disponga de un valor para este campo, completar con 50 caracteres de espacio en blanco.

14. Cantidad de unidades

Deberá informar el número de unidades del instrumento.

15.Moneda

Corresponde a la moneda o unidad de reajuste en que se encuentre expresado el instrumento. Para estos efectos deberá utilizarse la codificación definida por esta Comisión, de acuerdo al estándar ISO-4217, la cual se encuentra disponible para consulta en el Módulo SEIL del sitio Web www.cmfchile.cl.

16.TIR, valor par o precio

Indicar la tasa interna de retorno ("TIR") utilizada en la valorización del instrumento de renta fija, o el porcentaje del valor par en el caso de instrumentos de tasa flotante, o el precio con el cual se valorizó el instrumento en el caso de los instrumentos de renta variable.

17. Código de valorización

Indicar el código según la valorización a que hace mención la variable "TIR, valor par o precio", de acuerdo con la siguiente codificación:

- **TR:** TIR.
- **VP:** Porcentaje del valor par.
- **PR:** Precio

18.Base tasa

Indicar, cuando corresponda, los días que cubre la tasa de valorización establecida en la variable "TIR, valor par o precio", mediante los números: 30, 360, 365, etc. En caso de que no se disponga de un valor para este campo, completar con 3 ceros.

19.Valorización al cierre

Indicar el monto total en pesos que representan los títulos valorizados a su valor razonable o a costo amortizado, según corresponda al cierre del día solicitado.

20.Código país de emisión del instrumento

Indicar el código del país donde se emitió el instrumento, de acuerdo con la codificación definida por esta Comisión, la cual se encuentra disponible para consulta en el Módulo SEIL del sitio Web www.cmfchile.cl.

21. Relacionado

Corresponde informar si el emisor del instrumento está relacionado con el intermediario de valores, de acuerdo con lo establecido en el artículo N°100 de la ley N°18.045 y sus modificaciones, de acuerdo con la siguiente codificación:

- **RE:** Relacionado.
- **NR:** No Relacionado

22.Fuente precios

Corresponde informar el nombre del proveedor de precio utilizado por el intermediario de valores para valorizar el instrumento.

23.Duración

En el caso de instrumentos de renta fija e intermediación financiera, se deberá indicar la duración del instrumento a la fecha de reporte (formato anual). En caso de que no se disponga de un valor para este campo, completar con 20 ceros

Registro de tipo 3, de totales

1. Tipo.....	9(01)
2. Total.....	9(10)
3. Filler.....	X(436)
Largo del registro 447 bytes	

1. Tipo de registro.

En este caso corresponde tipo 3. Registrar:

- 3

2. Total

Debe informar el número total de registros informados dentro del archivo, considerando este registro de totales.

3. Filler

Se deberá informar espacios.