Logotipo, nombre de la empresa

Descripción generada automáticamente

**SINACOFI**

**Definición documento R07(718) - Activos ponderados por riesgo de mercado.**

SONEDI Soluciones de Negocio Digitales

Av. Apoquindo 5555 – Piso 14

Santiago – Chile

Tel/Fax.: (562) 26569646

Contenido

[1. Definición de estructuras 5](#_Toc152339470)

[1.1. Archivo de datos del emisor Manual Sistema de Información Bancos - Sistema Contable (cmfchile.cl) 5](#_Toc152339471)

[1.2. Archivo Carátula/s del origen (Carátula de entrada) 6](#_Toc152339472)

[1.3. Archivo/s de control de datos del origen 6](#_Toc152339473)

[1.4. Archivo/s de datos del Receptor: 8](#_Toc152339474)

[1.5. Archivo de carátula del Receptor 8](#_Toc152339475)

[1.6. Archivo de Control del Receptor 8](#_Toc152339476)

[2. Validaciones 9](#_Toc152339477)

[2.1. Archivo de datos 9](#_Toc152339478)

[2.2. Archivo Carátula: 9](#_Toc152339479)

[2.3. Archivo de control de datos: 11](#_Toc152339480)

[3. Construyendo la carátula de salida 13](#_Toc152339481)

[3.1. Formato de carátula de salida 14](#_Toc152339482)

[4. Definición de nombres 16](#_Toc152339483)

[4.1. Archivos de entrada a SINACOFI 16](#_Toc152339484)

[4.1.1. Archivo de datos: 16](#_Toc152339485)

[4.1.2. Archivo Carátula: 16](#_Toc152339486)

[4.1.3. Archivo de control de datos: 17](#_Toc152339487)

[4.2. Archivo de salida a destino 17](#_Toc152339488)

[4.2.1. Archivo de datos 17](#_Toc152339489)

[4.2.2. Archivo Carátula 17](#_Toc152339490)

[4.3. Definición de correlativo 18](#_Toc152339491)

[5. Definición del destino 19](#_Toc152339492)

[6. Mensajería 20](#_Toc152339493)

[6.1. Aviso 20](#_Toc152339494)

[6.2. Resultado 20](#_Toc152339495)

[6.3. Notificación 20](#_Toc152339496)

[6.4. Resultado RES.DET 20](#_Toc152339497)

[7. Definir estructura y nombre para cada archivo de mensajería 21](#_Toc152339498)

[7.1. Estructura 21](#_Toc152339499)

[7.1.1. Archivo notificado (CMF): 21](#_Toc152339500)

[7.1.2. Archivo aviso (SINACOFI) 21](#_Toc152339501)

[7.1.3. Archivo resultado (SINACOFI) 21](#_Toc152339502)

[7.2. Definición de nombres: 22](#_Toc152339503)

[8. Datos sensibles 22](#_Toc152339504)

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| X | Cassds Canal Web |  |
|  | Canal FT3 |  |

**Control de versiones:**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Nombre documento | Fecha | Responsable | Versión | Observaciones |
| R07 | 08-05-2024 | Claudio Velasquez  Jonathan Arce  Oliver Silva | 1.0 | Creación documento |
| R07 | 12-06-2024 | Claudio Velasquez  Jonathan Arce  Oliver Silva | 2.0 | Revision |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |

# Definición de estructuras

## Archivo de datos del emisor [Manual Sistema de Información Bancos - Sistema Contable (cmfchile.cl)](https://www.cmfchile.cl/portal/principal/613/articles-29208_doc_pdf.pdf)

Header:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Código de la institución financiera | 9(04) |
| Campo 2 | : | Identificación del archive | X(03) |
| Campo 3 | : | Periodo | F(08) AAAAMMDD |
| Campo 4 | : | Filler | X(179) |

Longitud Total del registro: 194

*Registros siguientes*

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Código 1 | : | Activos ponderados por riesgo de mercado por modelo estándar simplificado |
| Código 2 | : | Riesgo general y específico de tasas de interés |
| Código 3 | : | Riesgo general y específico de cotizaciones bursátiles |
| Código 4 | : | Riesgo de materias primas |
| Código 5 | : | Riesgo de moneda extranjera |
| Código 6 | : | Riesgo de opciones |
| Código 7 | : | Detalle de riesgo de opciones a través de método de escenarios |
| Código 8 | : | Posiciones excluidas del marco de riesgo general de tasa de interés |
| Código 9 | : | Detalle de securitizaciones |

*Registro para informar activos ponderados por riesgo de mercado por modelo estándar simplificado*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Fecha | F(08) |
| Campo 3 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 4 | : | APRM | 9(14) |
| Campo 5 | : | Riesgo específico de tasa de interés | 9(14) |
| Campo 6 | : | Riesgo general de tasa de interés | 9(14) |
| Campo 7 | : | Riesgo de moneda extranjera | 9(14) |
| Campo 8 | : | Riesgo de materias primas | 9(14) |
| Campo 9 | : | Riesgo específico de cotizaciones bursátiles | 9(14) |
| Campo 10 | : | Riesgo general de cotizaciones bursátiles | 9(14) |
| Campo 11 | : | Riesgo de opciones sobre tasa de interés | 9(14) |
| Campo 12 | : | Riesgo de opciones sobre monedas | 9(14) |
| Campo 13 | : | Riesgo de opciones sobre cotizaciones bursátiles | 9(14) |
| Campo 14 | : | Riesgo de opciones sobre materias primas | 9(14) |
| Campo 15 | : | Cargo por traspaso de instrumentos entre libros | 9(14) |
| Campo 16 | : | Securitizaciones | 9(14) |
| Campo 17 | : | Filler | X(01) |

Longitud Total del registro: 194 Bytes

*Registro para informar riesgo general y específico de tasas de interés*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Fecha | F(08) |
| Campo 3 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 4 | : | Fondos | 9(02) |
| Campo 5 | : | Exposiciones | 9(02) |
| Campo 6 | : | Tipo de tasa de interés | 9(02) |
| Campo 7 | : | Riesgo específico de tasa de interés | 9(02) |
| Campo 8 | : | Moneda | 9(03) |
| Campo 9 | : | Banda temporal | 9(02) |
| Campo 10 | : | Monto posición riesgo específico | 9(16) |
| Campo 11 | : | Monto posición riesgo general | 9(16) |
| Campo 12 | : | Monto posiciones perfectamente compensadas | 9(16) |
| Campo 13 | : | Filler | X(122) |

Longitud Total del registro: 194 Bytes

*Registro para informar riesgo general y específico de cotizaciones bursátiles.*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Fecha | F(08) |
| Campo 3 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 4 | : | Fondos | 9(02) |
| Campo 5 | : | Exposiciones | 9(02) |
| Campo 6 | : | Moneda | 9(03) |
| Campo 7 | : | Jurisdicción mercado bursátil | 9(03) |
| Campo 8 | : | Monto posición | 9(14) |
| Campo 9 | : | Filler | X(159) |

Longitud Total del registro: 194 Bytes

*Registro para informar riesgo de materias primas*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Fecha | F(08) |
| Campo 3 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 4 | : | Fondos | 9(02) |
| Campo 5 | : | Exposiciones | 9(02) |
| Campo 6 | : | Materia prima | 9(02) |
| Campo 7 | : | Monto posición | 9(14) |
| Campo 8 | : | Filler | X(163) |

Longitud Total del registro: 194 Bytes

*Registro para informar riesgo de moneda extranjera*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Fecha | F(08) |
| Campo 3 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 4 | : | Fondos | 9(02) |
| Campo 5 | : | Exposiciones | 9(02) |
| Campo 6 | : | Moneda | 9(03) |
| Campo 7 | : | Monto posición | 9(14) |
| Campo 8 | : | Filler | X(162) |

Longitud Total del registro: 194 Bytes

*Registro para informar riesgo de opciones*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Fecha | F(08) |
| Campo 3 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 4 | : | Id estrategia | 9(02) |
| Campo 5 | : | Moneda | 9(03) |
| Campo 6 | : | Método | 9(02) |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 7 | : | Valor posición | s9(14) |
| Campo 8 | : | Valor subyacente | 9(14) |
| Campo 9 | : | Valor o variación riesgo de tasa de interés | s9(14) |
| Campo 10 | : | Valor o variación riesgo de moneda extranjera | s9(14) |
| Campo 11 | : | Valor o variación riesgo de materias primas | s9(14) |
| Campo 12 | : | Valor o variación riesgo de cotizaciones bursátiles | s9(14) |
| Campo 13 | : | Filler | X(87) |

Longitud Total del registro: 194 Bytes

*Registro para informar detalle de riesgo de opciones a través de método de escenarios*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Fecha | F(08) |
| Campo 3 | : | Id estrategia | 9(02) |
| Campo 4 | : | Clase de riesgo | 9(02) |
| Campo 5 | : | Subclase de riesgo | 9(05) |
| Campo 6 | : | Id scenario | 9(02) |
| Campo 7 | : | Valor posición | s9(14) |
| Campo 8 | : | Variación valor subyacente | s9(14) |
| Campo 9 | : | Variación volatilidad | s9(14) |
| Campo 10 | : | Ganancia o pérdida bruta | s9(14) |
| Campo 11 | : | Ganancia o pérdida cubierta | s9(14) |
| Campo 12 | : | Filler | X(98) |

Longitud Total del registro: 194 Bytes

*Registro para informar posiciones excluidas del marco de riesgo general de tasa de interés*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Fecha | F(08) |
| Campo 3 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 4 | : | Sistema | 9(02) |
| Campo 5 | : | Identificador del contrato SIID | X(52) |
| Campo 6 | : | Identificador del contrato no reportado al SIID | X(30) |
| Campo 7 | : | Filler | X(99) |

Longitud Total del registro: 194 Bytes

*Registro para informar detalle de securitizaciones*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Fecha | F(08) |
| Campo 3 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 4 | : | Clasificación de riesgo | 9(04) |
| Campo 5 | : | País | 9(03) |
| Campo 6 | : | Tipo de active | 9(02) |
| Campo 7 | : | Tipo de tramo | 9(02) |
| Campo 8 | : | Madurez | 9(01)V9(03) |
| Campo 9 | : | Cumplimiento de criterios | 9(02) |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 10 | : | PRM utilizado | 9(04)V9(01) |
| Campo 11 | : | Monto posición | 9(14) |
| Campo 12 | : | Filler | X(147) |

Longitud Total del registro: 194 Bytes

# Validaciones

## Archivo de datos

|  |  |
| --- | --- |
| **V1** | **Validar el largo de registro en función al tipo de documento (tabla en base de datos); En caso de no coincidir, se deberá catalogar con error (Error 65)**  **Solo para líneas de “detalle”** |
| **V2** | **Validar que el código del banco (largo 4) se coteja con el usuario conectado (definición de casilla), en caso de no coincidir se catalogará con error (Error 05)** |
| **V3** | **Se debe cotejar que el tipo de documento definido en el *header* del archivo existe en la base de datos (tabla mantenedora). (Error 83)** |
| **V4** | **Validar que el archivo tenga datos, en caso contrario error (Error 40)** |
| **V5** | **Validar formato del campo fecha en la línea *header,* en caso de error (Error 74)**  **Obs: Un año es válido cuando es mayor a 1950.** |
| **V6** | **Se debe validar que el área deberá estar asociada a una familia de documento, en caso contrario (Error 84)** |
| **V7** | **Se debe validar que el área definida para la familia de documento contiene usuarios, en caso contrario (Error 90)** |
| **V8** | **Validar que el tipo de documento no ha sido eliminado, en caso contrario (Error 87)** |
| **V9** | **Validar que la casilla origen existe en base de datos, en caso de no existir (Error 7)** |
| **V10** | **Validar la existencia del tipo de documento en la línea *header* del archivo, en caso de no existir (Error 89)** |
| **V11** | **Validar que el tipo de documento este asociado a su flujo, en caso contrario (Error 86)** |

## Validaciones variables asociadas al documento R07

|  |  |
| --- | --- |
| **V12** | **Validar que el campo “Tipo de registro” tenga los valores esperados 01,02,03,04,05,06,07,08 o 09 en caso contrario (Error 75) .** |
| **V3** | **Se debe cotejar que el tipo de documento definido en el *header* del archivo existe en la base de datos (tabla mantenedora). (Error 83)** |

# Construyendo la carátula de salida

## Formato de carátula de salida

El formato F3 (nf) es:

<nro. Línea 1><valor campo 1><valor decimal campo 1><signo campo 1><fin de línea>

….

<nro. Línea 2><valor campo 2><valor decimal campo 2><signo campo 2><fin de línea>

….

<nro. Línea m><valor campo m><valor decimal campo m><signo campo m><fin de línea>

…

<nro. Línea N><valor campo N><valor decimal campo N><signo campo N><fin de línea> Donde:

* <nro. Línea m>

Es un correlativo numérico y secuencial que comienza en 1 y el largo es 3.

* <valor campo m>

Representa el campo m del mensaje carátula del tipo de archivo el cual tiene un largo de 30 dígitos, rellenado con el valor 0 a la izquierda.

* <valor decimal campo m>

Representa el valor decimal del campo m del mensaje carátula del tipo de archivo, tiene un largo de 4 dígitos, rellenado con valor 0 a la izquierda cuando es menor a 4.

* <signo campo m>

Esto representa el signo del campo m del mensaje carátula, debe ser +, siendo de largo 1 posición.

El signo lo define el archivo de entrada

* <fin de línea>

Carácter fin de línea en formato Linu:x.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ITEM |  | CODIGO | Descripción / Forma de cálculo. | Caratula |
| **1** | **:** | **G01** | **DATOS CONTROL TRANSFERENCIA** |  |
| **2** | **:** | **18** | **NOMBRE Y CARGO RESPONS INFORM** |  |
| **3** | **:** | **20** | **NUESTRA REFERENCIA** |  |
| **4** | **:** | **34** | **FECHA VALIDEZ DATOS** |  |
| **5** | **:** | **PA1** | **NUMERO DE REGISTROS INFORMADOS** | Sí |
| **6** | **:** | **IDC** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 01 EN EL PRIMER CAMPO** | Sí |
| **7** | **:** | **IDD** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 02 EN EL PRIMER CAMPO** | Sí |
| **8** | **:** | **IDE** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 03 EN EL PRIMER CAMPO** | Sí |
| **9** | **:** | **IDF** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 04 EN EL PRIMER CAMPO** | Sí |
| **10** | **:** | **IDG** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 05 EN EL PRIMER CAMPO** | Sí |
| **11** | **:** | **IDH** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 06 EN EL PRIMER CAMPO** | Sí |
| **12** | **:** | **IDI** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 07 EN EL PRIMER CAMPO** | Sí |
| **13** | **:** | **IDO** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 08 EN EL PRIMER CAMPO** | Sí |
| **14** | **:** | **IDP** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 09 EN EL PRIMER CAMPO** | Sí |
| **15** | **:** | **79** | **Observaciones** |  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Formato de Archivo de la Carátula de salida | : | F3(F) |
| Campos a incluir en la Carátula de salida | : | 5,6,7,8,9,10,11,12,13,14 |

Definir el archivo de carátula de salida, a modo de ejemplo se espera:

0010000000000000009999999999999990000+

0020000000000000009999999999999990000+

0030000000000000009999999999999990000+

0040000000000000009999999999999990000+

0050000000000000009999999999999990000+

0060000000000000009999999999999990000+

0070000000000000009999999999999990000+

0080000000000000009999999999999990000+

0090000000000000009999999999999990000+

0100000000000000009999999999999990000+

# Definición de nombres

## Archivo de salida a destino

## Archivo de datos

|  |  |
| --- | --- |
| **CMF**  **Instit.Bancaria** | **R07####a.XXXX**  **XXXX: Código Institución origen de largo 4**  **####:**  **Es un correlativo número asignado por el sistema de largo 4** |

## Archivo Carátula

|  |  |
| --- | --- |
| **CMF**  **Instit.Bancaria** | **R07####c.XXXX**  **XXXX: Código Institución origen de largo 4**  **####: Es un correlativo número asignado por el sistema de largo 4** |

**Los archivos deben ir a una cuarta carpeta denominada:**

**\salida**

**Para toda institución (Bancaria-CMF-Banco Central)**

## Definición de correlativo

## Salida

El correlativo es único y se define por Institución Receptora (CMF-Bancos)

## Entrada

El correlativo es único y se define por Institución

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ITEM |  | CODIGO | Descripción / Forma de cálculo. | Accion |
| **1** | **:** | **G01** | **DATOS CONTROL TRANSFERENCIA** | no se modifica |
| **2** | **:** | **18** | **NOMBRE Y CARGO RESPONS INFORM** | Ingresar |
| **3** | **:** | **20** | **NUESTRA REFERENCIA** | Ingresar |
| **4** | **:** | **34** | **FECHA VALIDEZ DATOS** | Se coloca Fecha de la línea header del archivo |
| **5** |  | **PA1** | **NUMERO DE REGISTROS INFORMADOS** | Se puede cambiar |
| **6** |  | **IDC** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 01 EN EL PRIMER CAMPO** | Se puede cambiar |
| **7** |  | **IDD** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 02 EN EL PRIMER CAMPO** | Se puede cambiar |
| **8** |  | **IDE** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 03 EN EL PRIMER CAMPO** | Se puede cambiar |
| **9** |  | **IDF** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 04 EN EL PRIMER CAMPO** | Se puede cambiar |
| **10** |  | **IDG** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 05 EN EL PRIMER CAMPO** | Se puede cambiar |
| **11** |  | **IDH** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 06 EN EL PRIMER CAMPO** | Se puede cambiar |
| **12** |  | **IDI** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 07 EN EL PRIMER CAMPO** | Se puede cambiar |
| **13** |  | **IDO** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 08 EN EL PRIMER CAMPO** | Se puede cambiar |
| **14** |  | **IDP** | **NUMERO DE REGISTROS CON CODIGO 09 EN EL PRIMER CAMPO** | Se puede cambiar |
| **15** |  | **79** | **Observaciones** | Ingresar |

# Definir Notificación hacia el Front.

El sistema deberá notificar en el Front lo siguiente:

1. En caso de éxito en la propuesta de cálculo: Se deberá incluir el siguiente texto “Se encuentra archivo disponible para su Aprobación (incluir nombre)”.
2. En caso de error (validación/transmisión): Se deberá incluir el texto “Se presentan problemas en la(s) validación(es) del archivo (incluir nombre)”.
3. Si la transmisión final fue exitosa, el mensaje será el siguiente “La transferencia se ha realizado en forma exitosa para el archivo (incluir nombre, correlativo salida y destino)”.

# Datos sensibles

-No hay