Logotipo, nombre de la empresa

Descripción generada automáticamente

**SINACOFI**

**Definición documento R13(726) - Riesgo de mercado de libro de banca (RMLB).**

SONEDI Soluciones de Negocio Digitales

Av. Apoquindo 5555 – Piso 14

Santiago – Chile

Tel/Fax.: (562) 26569646

Contenido

[1. Definición de estructuras 4](#_Toc166057838)

[1.1. Archivo de datos del emisor Manual Sistema de Información Bancos - Sistema Contable (cmfchile.cl) 4](#_Toc166057839)

[2. Validaciones 7](#_Toc166057840)

[2.1. Archivo de datos 7](#_Toc166057841)

[3. Construyendo la carátula de salida 7](#_Toc166057842)

[3.1. Formato de carátula de salida 7](#_Toc166057843)

[4. Definición de nombres 10](#_Toc166057844)

[4.1. Archivo de salida a destino 10](#_Toc166057845)

[4.1.1. Archivo de datos 10](#_Toc166057846)

[4.1.2. Archivo Carátula 10](#_Toc166057847)

[4.2. Definición de correlativo 10](#_Toc166057848)

[4.2.1. Salida 10](#_Toc166057849)

[4.2.2. Entrada 10](#_Toc166057850)

[5. Definir Notificación hacia el Front. 11](#_Toc166057851)

[6. Datos sensibles 12](#_Toc166057852)

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

**Control de versiones:**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Nombre documento | Fecha | Responsable | Versión | Observaciones |
| R13 | 07-05-2024 | Claudio Velasquez  Jonathan Arce  Alejandro Aravena | 1.0 | Creación documento |
| R13 | 11-06-2024 | Claudio Velasquez  Jonathan Arce  Alejandro Aravena | 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) | 9(04) | Código de la institución financiera | 9(04) |
| Campo 2 | : | Identificación del archive | X(03) | X(03) | Identificación del archivo | X(03) |
| Campo 3 | : | Periodo | P(06) AAAAMM | F(08) AAAAMMDD | Periodo | F(08) AAAAMMDD |
| Campo 4 | : | Filler | X(75) | X(55) | Filler | X(129) |

Longitud Total del registro: 88 Bytes

*Registros siguientes*

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Código 1 | : | Medición de impactos. |
| Código 2 | : | Impactos por escenarios de perturbación. |
| Código 3 | : | Flujos de efectivo nocional a repricing. |
| Código 4 | : | Opciones implícitas y explícitas. |
| Código 5 | : | Curvas de tasas de interés. |
| Código 6 | : | Flujos contractuales de posiciones no susceptibles de estandarización. |
| Código 7 | : | Posiciones sujetas a riesgo de reajustabilidad. |

*Registro para informar medición de impactos(Cod.01)*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 3 | : | Impacto en generación de intereses netos de corto plazo | 9(14) |
| Campo 4 | : | Impacto en generación de reajustes netos de corto plazo | 9(14) |
| Campo 5 | : | Margen neto de intereses y reajustes | 9(14) |
| Campo 6 | : | Límite generación de intereses y reajustes netos de corto plazo | 9(04)V9(03) |
| Campo 7 | : | Impacto en valor económico | 9(14) |
| Campo 8 | : | Capital nivel 1 | 9(14) |
| Campo 9 | : | Límite al valor económico | 9(04)V9(03) |
| Campo 10 | : | Filler | X(01) |

Longitud Total del registro: 88 Bytes

*Registro para informar impactos por escenarios de perturbación(Cod.02)*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 3 | : | Tipo de impacto | 9(02) |
| Campo 4 | : | Moneda | 9(03) |
| Campo 5 | : | Escenarios de perturbación | 9(02) |
| Campo 6 | : | Impacto | s9(14) |
| Campo 7 | : | Filler | X(63) |

Longitud Total del registro: 88 Bytes

*Registro para informar flujos de efectivo nocional a repricing (Cod.03)*

*.*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 3 | : | Tipo de exposición | 9(02) |
| Campo 4 | : | Tipo de contraparte | 9(02) |
| Campo 5 | : | Origen del flujo | 9(02) |
| Campo 6 | : | Escenario de perturbación | 9(02) |
| Campo 7 | : | Banda temporal | 9(02) |
| Campo 8 | : | Moneda | 9(03) |
| Campo 9 | : | Tipo de tasa | 9(02) |
| Campo 10 | : | Tipo de flujo | 9(02) |
| Campo 11 | : | Monto flujo | 9(14) |
| Campo 12 | : | Spread | s9(02)V9(03) |
| Campo 13 | : | Filler | X(48) |

Longitud Total del registro: 88 Bytes

*Registro para informar opciones implícitas y explícitas(Cod.04)*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 3 | : | Tipo de opción | 9(02) |
| Campo 4 | : | Tipo de contraparte | 9(02) |
| Campo 5 | : | Origen del flujo | 9(02) |
| Campo 6 | : | Escenario de perturbación | 9(02) |
| Campo 7 | : | Moneda | 9(03) |
| Campo 8 | : | Monto | s9(14) |
| Campo 9 | : | Filler | X(59) |

Longitud Total del registro: 88 Bytes

*Registro para informar curvas de tasas de interés. (Cod.05)*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Moneda | 9(03) |
| Campo 3 | : | Banda temporal | 9(02) |
| Campo 4 | : | Tasa de interés | s9(02)V9(03) |
| Campo 5 | : | Filler | X(75) |

Longitud Total del registro: 88 Bytes

*Registro para informar flujos contractuales de posiciones no susceptibles de estandarización(Cod.06)*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 3 | : | Tipo de exposición | 9(02) |
| Campo 4 | : | Tipo de contraparte | 9(02) |
| Campo 5 | : | Origen del flujo | 9(02) |
| Campo 6 | : | Banda temporal | 9(02) |
| Campo 7 | : | Moneda | 9(03) |
| Campo 8 | : | Tipo de flujo | 9(02) |
| Campo 9 | : | Monto flujo | 9(14) |
| Campo 10 | : | Filler | X(58) |

Longitud Total del registro: 88 Bytes

*Registro para informar posiciones sujetas a riesgo de reajustabilidad (Cod.07)*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Campo 1 | : | Tipo de registro | 9(02) |
| Campo 2 | : | Nivel de consolidación | 9(01) |
| Campo 3 | : | Origen de la exposición | 9(02) |
| Campo 4 | : | Monto | s9(14) |
| Campo 5 | : | Filler | X(68) |

Longitud Total del registro: 88 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 R13

|  |  |
| --- | --- |
| **V12** | **Validar que el campo “Tipo de registro” tenga los valores esperados 01,02,03,04,05,06 o 07 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** | **:** | **79** | **Observaciones** |  |

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

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

0010000000000000009999999999999990000+

0020000000000000009999999999999990000+

0030000000000000009999999999999990000+

0040000000000000009999999999999990000+

0050000000000000009999999999999990000+

0060000000000000009999999999999990000+

0070000000000000009999999999999990000+

0080000000000000009999999999999990000+

# Definición de nombres

## Archivo de salida a destino

## Archivo de datos

|  |  |
| --- | --- |
| **CMF**  **Instit.Bancaria** | **R13####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** | **R13####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** |  | **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