

SANTIAGO, Julio 15 de 1985.

C I R C U L A R N° 524 /

Para todos los corredores de bolsa y agentes de valores.

Esta Superintendencia, en uso de sus facultades legales, y considerando las modificaciones a la normativa para los intermediarios de valores, impartidas a través de la Norma de Carácter General N° 17 de fecha 11 de Junio de 1985 y las Circulares N°s 511, 513 y 514, de fechas 11, 12 y 13 de Junio 1985, respectivamente, ha estimado necesario modificar los requisitos de información contenidos en la Circular N° 486 de 26 de Febrero de 1985, reemplazando la Sección IV, por la siguiente:

"IV. Requisitos de Información

Los intermediarios de valores que efectúen las operaciones señaladas en esta circular, deberán enviar a esta Superintendencia un informe de los compromisos vigentes a los días 15 y último de cada mes, conforme a las especificaciones que se indican en los puntos 1 y 2 a continuación. Cuando los días señalados coincidan con un día festivo, sábado o domingo, el informe deberá referirse al día hábil inmediatamente anterior.

La información requerida deberá enviarse a este Servicio, antes de las 14 horas del tercer día hábil posterior al día informado.

259

SUPERINTENDENCIA DE
VALORES Y SEGUROS
CHILE

1.- Cuadro de Compromisos Vigentes según Plazo al Vencimiento de los Valores Comprometidos

Este cuadro mostrará las operaciones de compromisos vigentes al día informado, clasificadas según los plazos al vencimiento de los valores comprometidos. Deberá presentarse conforme al formato del Cuadro N° 2 adjunto, ateniéndose a las siguientes consideraciones :

a) Tipo de Operación : Las operaciones definidas en la Sección II de esta circular, se agruparán de la siguiente forma :

VRCC	:	Ventas con compromiso de retrocompra calzadas.
VRNC	:	Ventas con compromiso de retrocompra no calzadas.
CRVC	:	Compras con compromiso de retroventa calzadas.
CRNC	:	Compras con compromiso de retroventa no calzadas.
CCC	:	Compromiso de compra calzados.
CCNC	:	Compromiso de compra no calzados.
CVC	:	Compromiso de venta calzados.
CVNC	:	Compromiso de venta no calzado.

Para cada una de las operaciones anteriores, se agruparán los valores comprometidos según la estructura de sus pagos futuros en los siguientes grupos :

Tipo 1 : Instrumentos cuya amortización y/o pago de intereses se efectúa a lo largo de su período de vigencia (vgr.: PPBC, PDP, CAR - E, letras hipotecarias, etc..)

000200

Tipo 2 : Instrumentos cuya amortización y pago de intereses se efectúa a su vencimiento. (vgr.: PRT, PPS, CAR - F, depósitos a plazo, etc..)

b) Plazo al Vencimiento de los Valores Comprometidos

Deberá señalarse el monto correspondiente a cada tipo de operación vigente al día que se informa, agrupadas en función del plazo que medie entre el día que se informa y la fecha de vencimiento del instrumento comprometido, conforme a los rangos que se detallan a continuación :

Grupo A : Hasta 90 días.
Grupo B : Entre 91 días y 360 días.
Grupo C : Entre 1 año un día y 5 años.
Grupo D : Entre 5 años un día y 12 años.
Grupo E : Más de 12 años.

Para estos efectos, los años son de 360 días.

c) Total

Deberá indicarse el monto total correspondiente a cada uno de los tipos de operaciones antes definidos.

2.- Cuadro de Compromisos de Compras o de Ventas Vigentes

Este cuadro mostrará un listado en que se individualizará cada uno de los compromisos generados en las operaciones ya mencionadas, que estén vigentes al día que se informa. 000261

Su presentación deberá hacerse en igual formato al establecido para el Libro de Registro de Compromisos, Cuadro N° 1 de

SUPERINTENDENCIA DE
VALORES Y SEGUROS
CHILE

esta circular, con la información que en él se establece. Sin embargo, para la columna " Código ", se debe utilizar los definidos en el número 1, letra a) de esta Sección, y la columna " Cliente " podrá presentarse sin individualizarlo, señalando en su lugar el tipo de cliente de acuerdo a la siguiente clasificación :

- Entidad financiera
- Intermediario de valores
- Empresa (distintas de las anteriores)
- Persona natural

No obstante la clasificación anterior, deberá señalarse con un asterisco junto al tipo de cliente cuando se trate de una entidad relacionada directa o indirectamente.

Además, aquellos clientes que tengan compromisos vigentes al día que se informa, que superen el 50% del Patrimonio Líquido del intermediario, deberán ser individualizados en hoja separada, señalando el porcentaje correspondiente.

Para determinar el Patrimonio Líquido se debe considerar lo establecido en la Norma de Carácter General N° 17.

Para determinar el porcentaje antes indicado, se deberá considerar lo siguiente :


- a) Los compromisos de compra o de venta vigentes en pesos, se valorizarán de acuerdo al monto comprometido pagar o recibir en pesos.
- b) Los compromisos de compra o de venta vigentes en unidades de fomento o moneda extranjera, se valorizarán de acuerdo al monto comprometido pagar o recibir, expresado en su equivalente en pesos al día informado.

000262

SUPERINTENDENCIA DE
VALORES Y SEGUROS
CHILE

No será necesario indicar, para estos efectos, en el referido cuadro, la información contenida en el numeral 2.5., de la Sección III de esta circular.

No obstante lo anterior, el intermediario deberá informar a esta Superintendencia si en el período comprendido entre la presentación anterior y la actual, no se hubiere materializado un compromiso en la fecha originalmente establecida, indicando en hoja aparte, nombre del cliente, tipo de operación, monto involucrado y motivos por los cuales no se materializó la operación".



FERNANDO ALVARADO ELISSETCHE
SUPERINTENDENTE

La Circular N° 523 fue enviada a todas las sociedades administradoras de fondos mutuos.

INFORME DE COMPROMISOS VIGENTES (CIFRAS M\$)

INFORME AL :
NOMBRE INTERMEDIARIO DE VALORES : _____

a) Tipo de Operación	b) Plazo al Vencimiento de los Valores Comprometidos					c) Total
	A	B	C	D	E	
VRCC	Total					
Tipo 1						
Tipo 2						
VRNC	Total					
Tipo 1						
Tipo 2						
CRVC	Total					
Tipo 1						
Tipo 2						
CRVNC	Total					
Tipo 1						
Tipo 2						
CCC	Total					
Tipo 1						
Tipo 2						
CCNC	Total					
Tipo 1						
Tipo 2						
CVC	Total					
Tipo 1						
Tipo 2						
CVNC	Total					
Tipo 1						
Tipo 2						
TOTAL						

NOMBRE Y FIRMA DEL REPRESENTANTE LEGAL : _____