

BASE DE CARTERA DE LOS FONDOS DE PENSIONES¹

MANUAL DE USO

Versión Actualizada mayo 2020

www.spensiones.cl

¹ Esta base es de uso exclusivo para fines de investigación. Se solicita no distribuir esta información.

I. Introducción.

La información de la base de Cartera de los Fondos de Pensiones se compone de un archivo con las siguientes características:

- Los datos de cada registro se encuentran delimitados por “;”.
- El **Tipo** definido para cada dato en la descripción de los registros, informa acerca de si el campo corresponde a una variable numérica (9) o si el campo corresponde a una variable alfanumérica (X).
- El número correlativo definido para cada dato en la descripción de los registros, bajo el título **Posición**, corresponde a la posición que ocupa el dato en el registro.
- El nombre de los archivos informados es: *cartera_mensual_xxxx.csv*. Donde xxxx corresponde al año contenido en la base.

II. Descripción de archivos

A continuación se describe la estructura de los registros de datos de cada uno de los archivos.

Archivo: <i>base_cartera_fp.csv</i>				
Información del campo	Tipo	Formato o contenido	Nota	Posición
fecha	9(08)	aaaammdd		1
afp	X(03)	(a)	(1)	2
tipo_de_fondo	X(01)	A, B, C, D o E		3
tipo_de_instrumento	X(04)	Ver Anexo I	(2)	4
nemotecnico_del_instrumento	X(16)		(3)	5
nombre_del_emisor	X(96)			6
nacionalidad_del_emisor	X(01)	(b)		7
unidad_de_reajuste_de_moneda	X(04)	(c)(d)		8
unidades	9(12)V9(04)		(4)	9
precio	9(12)V9(02)		(5)	10
inversion	9(14)		(6)	11
grupo_economico	9(2)V9(0)		(7)	12
moneda_contrato_forward	X(3)	(d)	(8)	13
moneda_objeto_forward	X(3)	(d)	(9)	14
precio_ejercicio_forward	9(12)V9(10)		(10)	15
plazo_economico	9(12)V9(0)		(11)	16
tasa_pactada_del_fondo_swap	X(24)		(12)	17
tasa_pactada_de_la_contraparte_s	X(24)		(13)	18

Notas:

- (1) Corresponde a la AFP que informa.
- (2) Indica la abreviatura correspondiente al tipo de instrumento que se informa. Los códigos vigentes se encuentran en el Anexo O del Capítulo IV, Título VIII, Libro IV del Compendio de Normas de la Superintendencia de Pensiones.
- (3) Corresponde al Nemotécnico definido o autorizado por la Comisión para el Mercado Financiero (CMF) de los Instrumentos nacionales o extranjeros informados. Las circulares de la CMF corresponden a la 1085 y sus modificaciones: 1089, 1097, 1102, 1464, 1617, 1648, 1747 y 2113. En http://www.cmfchile.cl/institucional/legislacion_normativa/normativa.php es posible buscar la circular 1085 y descargar el texto refundido donde se incluyen todas sus actualizaciones.
- (4) Se refiere a las unidades del instrumento en la cartera del Fondo.
- (5) Muestra el precio de los Instrumentos Financieros y Operaciones de Cobertura de Riesgo, expresado en pesos y centavos.
- (6) Indica la cantidad Total invertida en el instrumento en pesos chilenos.
- (7) Variable que señala el grupo empresarial del Emisor, la información de los grupos se comunica periódicamente a través de circulares de la Superintendencia de Pensiones en base a la información proporcionada a su vez, por la Comisión para el Mercado Financiero en <http://www.cmfchile.cl/portal/principal/605/w3-propertyvalue-18651.html>.
- (8) Corresponde a la Moneda contraparte de los contratos forward.
- (9) Corresponde a la Moneda Objeto de los contratos forward.
- (10) Señala el precio por unidad del activo objeto.
- (11) Se refiere a la duración del Instrumento Financiero. El plazo de los Instrumentos de Intermediación Financiera y de Renta Fija o Seriados se encuentra en la letra E de la Circular 1.216 de la Superintendencia de Pensiones (disponible en <http://www.spensiones.cl/files/normativa/circulares/CAFP1216.pdf>).
- (12) Corresponde a la tasa de interés pactada por el Fondo de Pensiones para efectuar los pagos de intereses sobre el capital insoluto. La nomenclatura para estas tasas se describe en la letra H del Capítulo IV, Título VIII, Libro IV del Compendio de Normas de la Superintendencia de Pensiones (<https://www.spensiones.cl/portal/compendio/596/w3-propertyvalue-3838.html>).



(13) Corresponde a la tasa de interés pactada por la contraparte del Fondo de Pensiones para efectuar los pagos de intereses sobre el capital insoluto. La nomenclatura para estas tasas se describe en la letra H del Capítulo IV, Título VIII, Libro IV del Compendio de Normas de la Superintendencia de Pensiones (<https://www.spensiones.cl/portal/compendio/596/w3-propertyvalue-3838.html>).

Descripción de códigos:

(a) AFP

apo	APORTA
arm	ARMONIZA
bsa	BANSANDER
cap	CAPITAL
cup	CUPRUM
fom	FOMENTA
fut	FUTURO
hab	HABITAT
mag	MAGISTER
mod	MODELO
pli	PLANVITAL
prt	PROTECCION
prv	PROVIDA
qua	QUALITAS
sta	SANTA MARIA
sum	SUMMA
uni	UNION
uno	UNO
val	VALORA

(b) Nacionalidad del Emisor

E Extranjero

(c) Unidad de Reajuste Moneda

NO Sin base de reajuste (en pesos chilenos)

UF Unidades de Fomento

(d) Nómina de Monedas y sus Códigos

Código	Moneda	Código	Moneda
AED	Dirham de los Emiratos Árabes Unidos	KRW	Won Surcoreano
ARS	Peso Argentino	KYD	Dólar de las Islas Caimán
AUD	Dólar Australiano	KZT	Tenge Kazajo
BMD	Dólar de Bermuda	MXN	Peso Mexicano
BRL	Real Brasileño	MYR	Ringgit Malayo
CAD	Dólar Canadiense	NOK	Corona Noruega
CNF	Franco Suizo	NZD	Dólar Neozelandés
NO	Peso Chileno	PAB	Balboa Panameño
CNY	Yuan Renminbi de China	PEN	Nuevo Sol Peruano
COP	Peso Colombiano	PHP	Peso Filipino
CZK	Corona Checa	PLN	Zloty Polaco
DKK	Corona Danesa	RUB	Rublo Ruso
DOP	Peso Dominicano	SEK	Corona Sueca
EGP	Libra Egipcia	SGD	Dólar de Singapur
EUR	Euro	THB	Baht Tailandés
GBP	Libra Esterlina	TRY	Nueva Lira Turca
HKD	Dólar de Hong Kong	TWD	Nuevo Dólar Taiwanés
HUF	Forint Húngaro	UAH	Grivnia Ucraniana
IDR	Rupiah Indonesia	US\$	Dólar Estadounidense
ILS	Nuevo Shéquel	VEF	Bolívar Fuerte Venezolano
INR	Rupia India	ZAR	Rand Sudafricano
JPY	Yen	UF	Unidad de Fomento
		OT	Otras

Fuente: Compendio de Normas Superintendencia de Pensiones.

Anexo I

Tipo de instrumento

Código	Descripción
ABE	Aceptaciones bancarias, esto es, títulos de crédito emitidos por terceros y afianzados por bancos extranjeros.
ACC	Acciones de Sociedades Anónimas Nacionales.
ACPE	Aportes comprometidos en vehículos para llevar a cabo inversión en activos de capital privado extranjeros.
ADD	Certificados negociables representativos de títulos de deuda de entidades extranjeras, emitidos por bancos depositarios en el extranjero.
ADPE	Aportes comprometidos en vehículos para llevar a cabo inversión en deuda privada extranjera
ADR	Certificados negociables representativos de títulos accionarios de entidades extranjeras, emitidos por bancos depositarios en el extranjero.
AEE	Acciones de Emisores Extranjeros.
ASC	Acciones de sociedades anónimas nacionales cerradas
BBC	Bonos del Banco Central de Chile
BCA	Bonos canjeables por acciones.
BCD	Bonos del Banco Central de Chile expresados en Dólares.
BCE	Bonos convertibles en acciones emitidos por entidades bancarias y empresas extranjeras.
BCO	Bonos de la Reforma Agraria (Primera y Segunda Serie).
BCP	Bonos del Banco Central de Chile expresados en pesos.
BCS	Bonos respaldados por títulos de crédito transferibles.
BCU	Bonos del Banco Central de Chile expresados en U.F.
BCX	Pagarés Banco Central de Chile en dólares.
BEC	Bonos del Estado de Chile.
BEE	Bonos emitidos por empresas extranjeras.
BEF	Bonos Bancarios emitidos por Instituciones Financieras.
BHM	Bonos Hipotecarios emitidos por instituciones Financieras
BME	Títulos de crédito emitidos por municipalidades, estados regionales o gobiernos locales.
BRP	Bonos de Reconocimiento emitidos por el Instituto de Normalización Previsional u otras instituciones de previsión.
BSE	Bonos de crédito securitizados emitidos por empresas extranjeras
BSF	Bonos subordinados emitidos por Instituciones Financieras.
BTP	Bonos de la Tesorería General de la República en Pesos.
BTU	Bonos de la Tesorería General de la República en UF.
BVL	Bonos Vivienda Leasing.
BFI	Bonos emitidos por fondos de inversión regulados por la ley N°20.712
CCPE	Operaciones de coinversión en capital privado extranjero
CC2	Cuenta Corriente Banco de Inversiones Nacionales.

CC3	Cuenta Corriente Banco de Inversiones Extranjeras.
CDCS	Compromiso de desembolsos futuros en un crédito sindicado
CDE	Títulos de crédito de intermediación financiera (Certificados de Depósitos) emitidos por entidades bancarias extranjeras.
CDPE	Operaciones de coinversión en deuda privada extranjera
CERO	Cupones de emisión Reajustables opcionales en U.F.
CFID	Cuotas de Fondos de Inversión Nacionales, cuyas carteras no están conformadas por ningún instrumento representativo de capital.
CFIV	Cuotas de Fondos de Inversión Nacionales, cuyas carteras están conformadas total o parcialmente por instrumentos representativos de capital.
CFMD	Cuotas de Fondos Mutuos Nacionales, cuyas carteras no están conformadas por ningún instrumento representativo de capital.
CFMV	Cuotas de Fondos Mutuos Nacionales, cuyas carteras están conformadas total o parcialmente por instrumentos representativos de capital.
CIED	Cuotas de participación emitidas por Fondos de Inversión extranjeros, cuyas carteras no están conformadas por ningún instrumento representativo de capital.
CIEV	Cuotas de participación emitidas por Fondos de Inversión extranjeros, cuyas carteras están conformadas total o parcialmente por instrumentos representativos de capital.
CLEA	Contrato de arrendamiento de bienes raíces no habitacionales con opción de compra (leasing).
CMED	Cuotas de participación emitidas por Fondos Mutuos Extranjeros, cuyas carteras no están conformadas por ningún instrumento representativo de capital.
CMEV	Cuotas de participación emitidas por Fondos Mutuos Extranjeros, cuyas carteras están conformadas total o parcialmente por instrumentos representativos de capital.
CREN	Contrato de arrendamiento de bienes raíces no habitacionales
CSIN	Participaciones en convenios de crédito (créditos sindicados)
DEB	Bonos de Empresas Públicas y Privadas.
DPF	Depósitos a Plazo emitidos por Instituciones Financieras.
EBC	Títulos de crédito emitidos por Estados Extranjeros y Bancos Centrales Extranjeros.
ECE	Efectos de comercio emitidos por entidades bancarias y empresas extranjeras
ECO	Efectos de Comercio.
ECS	Efectos de comercio respaldados por títulos de crédito transferibles
ELN	Títulos de crédito indexados al retorno de otros activos.
EPA	Acciones de sociedades en comandita por acciones
ETFA	Títulos representativos de índices accionarios extranjeros.
ETFB	Títulos representativos de índices de renta fija.
ETFC	Títulos representativos de índices de commodities.
FEAC	Futuros extranjeros de compra de acciones
FEAV	Futuros extranjeros de venta de acciones
FEIC	Futuros extranjeros de compra de índices
FEIV	Futuros extranjeros de venta de índices

FEMC	Futuros de compra de monedas en el extranjero.
FEMV	Futuros de venta de monedas en el extranjero.
FETC	Futuros de compra de tasas de interés sobre una tasa, índice o título de deuda extranjero correspondientes a operaciones de cobertura de riesgo financiero en el extranjero.
FETV	Futuros de venta de tasas de interés en el extranjero.
FICE	Cuotas de Participación Emitidas por Fondos de Inversión Extranjeros.
FNAC	Futuros nacionales de compra de acciones
FNAV	Futuros nacionales de venta de acciones
FNIC	Futuros nacionales de compra de índices
FNIV	Futuros nacionales de venta de índices
FNMC	Futuros de compra de monedas en el mercado nacional.
FNMV	Futuros de venta de monedas en el mercado nacional.
FNTC	Futuros de compra de tasas de interés.
FNTV	Futuros de venta de tasas de interés.
KCPE	Aportes comprometidos en operaciones de coinversión en capital privado extranjero
KDPE	Aportes comprometidos en operaciones de coinversión en deuda privada extranjera
LHF	Letras Hipotecarias emitidas por Instituciones Financieras.
LTP	Letras Hipotecarias emitidas por Instituciones Financieras
MHE	Mutuos hipotecarios endosables, del Título V del DFL N°251 de 1931, con fines no habitacionales.
OEAC	Opciones de compra extranjeras sobre acciones
OEAV	Opciones de venta extranjeras sobre acciones
OEIC	Opciones de compra extranjeras sobre índices
OEIV	Opciones de venta extranjeras sobre índices
OEMC	Opciones de compra de monedas en el extranjero
OEMV	Opciones de venta de monedas en el extranjero
OETC	Opciones de compra extranjeras sobre tasas de interés
OETV	Opciones de venta extranjeras sobre tasas de interés
ONAC	Opciones de compra nacionales sobre acciones
ONAV	Opciones de venta nacionales sobre acciones
ONIC	Opciones de compra nacionales sobre índices
ONIV	Opciones de venta nacionales sobre índices
ONMC	Opciones de compra de monedas en el mercado nacional
ONMV	Opciones de venta de monedas en el mercado nacional
ONTC	Opciones de compra nacionales sobre tasas de interés
ONTV	Opciones de venta nacionales sobre tasas de interés
OSAE	Opciones de suscripción de acciones y cuotas de fondos de inversión extranjeras.
OSAN	Opciones de suscripción de acciones y cuotas de fondos de inversión nacionales.
OVN	Instrumentos de intermediación financiera con plazo de emisión de 1 día, correspondientes a depósitos de corto plazo, emitidos por entidades bancarias extranjeras.
PCX	Pagarés del Banco Central de Chile en dólares de EEUU

PDC	Pagarés Descontables del Banco Central de Chile.
PFI	Promesas de suscripción y pago de cuotas de Fondos de Inversión Nacionales.
PRC	Pagarés Reajustables del Banco Central de Chile con pago en cupones.
PRD	Pagarés Reajustables en dólares del Banco Central de Chile.
PTG	Pagarés Reajustables de la Tesorería General de la República.
RAIZ	Bienes raíces no habitacionales
SEI	Swap extranjero de índices de tasas de interés
SEM	Swap extranjero en moneda
SET	Swap extranjero de tasas de interés
SIN /SNI	Swap nacional de índices de tasas de interés
SNM	Swap nacional en moneda
SNT	Swap nacional de tasas de interés
SPA	Acciones de sociedades por acciones
TBE	Títulos de crédito de renta fija emitidos por entidades bancarias extranjeras.
TBI	Títulos de crédito emitidos por entidades bancarias internacionales.
TDP	Instrumentos de intermediación financiera con plazo de emisión de más de 1 día, correspondientes a depósitos de corto plazo, emitidos por entidades bancarias extranjeras.
TGE	Títulos de crédito garantizados por Estados extranjeros, bancos centrales extranjeros, entidades bancarias extranjeras o entidades bancarias internacionales.
VCPE	Vehículos para llevar a cabo inversión en activos de capital privado extranjeros, incluyendo activos de capital asociados a los sectores infraestructura e inmobiliario. Se incluyen limited partnerships (LP), limited liability companies (LLC) y otros vehículos de funcionamiento equivalente, tales como Fund-of-One y Business Development Companies (BDC)
VDPE	Vehículos para llevar a cabo inversión en deuda privada extranjera, incluyendo deuda asociada a los sectores infraestructura e inmobiliario. Se incluyen limited partnerships (LP), limited liability companies (LLC) y otros vehículos de funcionamiento equivalente, tales como Fund-of-One y Business Development Companies (BDC)
WEAC	Forwards extranjeros de compra de acciones
WEAV	Forwards extranjeros de venta de acciones
WEIC	Forwards extranjeros de compra de índices
WEIV	Forwards extranjeros de venta de índices
WEMC	Forwards de compra de monedas en que ambas monedas involucradas son extranjeras
WEMV	Forwards de venta de monedas en que ambas monedas involucradas son extranjeras
WENC	Forwards de compra de monedas en el extranjero en que una de las monedas involucradas es nacional
WENV	Forwards de compra de monedas en el extranjero en que una de las monedas involucradas es nacional
WETC	Forwards de compra de tasas de interés en el extranjero.
WETV	Forwards de venta de tasas de interés en el extranjero.
WNAC	Forwards nacionales de compra de acciones
WNAV	Forwards nacionales de venta de acciones
WNIC	Forwards nacionales de compra de índices
WNIV	Forwards nacionales de venta de índices
WNMC	Forwards de compra de monedas en que una de las monedas involucradas es nacional

WNMV	Forwards de venta de monedas en que una de las monedas involucradas es nacional
WNNC	Forwards nacionales de compra de monedas en que ambas monedas involucradas son extranjeras
WNNV	Forwards nacionales de venta de monedas en que ambas monedas involucradas son extranjeras
WNTC	Forwards de compra de tasas de interés en el mercado nacional.
WNTV	Forwards de venta de tasas de interés en el mercado nacional.
XERO	Cupones de emisión del Banco Central de Chile en dólares de EEUU
XEAC	Forwards extranjeros de compra de acciones que se liquidan en Cámaras de Compensación
XEAV	Forwards extranjeros de venta de acciones que se liquidan en Cámaras de Compensación
XEIC	Forwards extranjeros de compra de índices que se liquidan en Cámaras de Compensación
XEIV	Forwards extranjeros de venta de índices que se liquidan en Cámaras de Compensación
XEMC	Forwards de compra de monedas en que ambas monedas involucradas son extranjeras y que se liquidan en Cámaras de Compensación
XEMV	Forwards de venta de monedas en que ambas monedas involucradas son extranjeras y que se liquidan en Cámaras de Compensación
XENC	Forwards de compra de monedas en el extranjero en que una de las monedas involucradas es nacional y que se liquidan en cámaras de compensación
XENV	Forwards de venta de monedas en el extranjero en que una de las monedas involucradas es nacional y que se liquidan en cámaras de compensación
XETC	Forwards de compra de tasas de interés en el extranjero que se liquidan en Cámaras de Compensación
XETV	Forwards de venta de tasas de interés en el extranjero que se liquidan en Cámaras de Compensación
XNAC	Forwards nacionales de compra de acciones que se liquidan en Cámaras de Compensación
XNAV	Forwards nacionales de venta de acciones que se liquidan en Cámaras de Compensación
XNIC	Forwards nacionales de compra de índices que se liquidan en Cámaras de Compensación
XNIV	Forwards nacionales de venta de índices que se liquidan en Cámaras de Compensación
XNMC	Forwards de compra de monedas en que una de las monedas involucradas es nacional y que se liquidan en Cámaras de Compensación
XNMV	Forwards de venta de monedas en que una de las monedas involucradas es nacional y que se liquidan en Cámaras de Compensación
XNTC	Forwards de compra de tasas de interés en el mercado nacional que se liquidan en Cámaras de Compensación
XNTV	Forwards de venta de tasas de interés en el mercado nacional que se liquidan en Cámaras de Compensación
XSET	Swap extranjero de tasas de interés que se liquida en cámaras de compensación
XSEI	Swap extranjero de índices de tasas de interés que se liquida en cámaras de compensación
XSEM	Swap extranjero de moneda que se liquida en cámaras de compensación
XSNT	Swap nacional de tasas de interés que se liquida en cámaras de compensación
XSNI	Swap nacional de índices de tasas de interés que se liquida en cámaras de compensación
XSNM	Swap nacional de moneda que se liquida en cámaras de compensación
YNAC	Forwards nacionales de compra de acciones que emplean garantías bilaterales
YNAV	Forwards nacionales de venta de acciones que emplean garantías bilaterales
YNIC	Forwards nacionales de compra de índices que emplean garantías bilaterales
YNIV	Forwards nacionales de venta de índices que emplean garantías bilaterales
YNMC	Forwards de compra de monedas en que una de las monedas involucradas es nacional y que emplean garantías bilaterales

YNMV	Forwards de venta de monedas en que una de las monedas involucradas es nacional y que emplean garantías bilaterales
YNTC	Forwards de compra de tasas de interés en el mercado nacional que emplean garantías bilaterales
YNTV	Forwards de venta de tasas de interés en el mercado nacional que emplean garantías bilaterales
YEAC	Forwards extranjeros de compra de acciones que emplean garantías bilaterales
YEAV	Forwards extranjeros de venta de acciones que emplean garantías bilaterales
YEIC	Forwards extranjeros de compra de índices que emplean garantías bilaterales
YEIV	Forwards extranjeros de venta de índices que emplean garantías bilaterales
YEMC	Forwards de compra de monedas en que ambas monedas involucradas son extranjeras y que emplean garantías bilaterales
YEMV	Forwards de venta de monedas en que ambas monedas involucradas son extranjeras y que emplean garantías bilaterales
YENC	Forwards de compra de monedas en el extranjero en que una de las monedas involucradas es nacional y que emplean garantías bilaterales
YENV	Forwards de venta de monedas en el extranjero en que una de las monedas involucradas es nacional y que emplean garantías bilaterales
YETC	Forwards de compra de tasas de interés en el extranjero que emplean garantías bilaterales
YETV	Forwards de venta de tasas de interés en el extranjero que emplean garantías bilaterales
YSET	Swap extranjero de tasas de interés que emplea garantías bilaterales
YSEI	Swap extranjero de índices de tasas de interés que emplea garantías bilaterales
YSEM	Swap extranjero de moneda que emplea garantías bilaterales
YSNT	Swap nacional de tasas de interés que emplea garantías bilaterales
YSNI	Swap nacional de índices de tasas de interés que emplea garantías bilaterales
YSNM	Swap nacional de moneda que emplea garantías bilaterales
ZERO	Cupones de emisión Reajustables opcionales en dólares.

Fuente: Compendio de Normas Superintendencia de Pensiones.