

## CATALOGO DE ARCHIVOS DEL SISTEMA DE INFORMACION.

### SISTEMA CONTABLE

<b>Código</b>	<b>NOMBRE</b>	<b>Periodicidad</b>	<b>Plazo</b> (días hábiles)
C01	Modelo de Balance	Mensual	6
C02	Modelo de Resultados	Mensual	6
C03	Control de Encaje	Diario	2
C04	Capital básico y patrimonio efectivo	Mensual	15
C05	Relación de operaciones activas y pasivas en moneda extranjera (2)	Mensual	9
C07	Relación de operaciones activas y pasivas en moneda chilena no reajustables (2)	Mensual	9
C08	Situación de liquidez	Semanal (1) Mensual (1)	3 9
C09	Flujos asociados al calce de tasas de interés (2)	Mensual	9
C10	Estados de Situación de Filiales	Trimestral	12
C14	SalDOS diarios de obligaciones con otras instituciones financieras del país	Mensual	9
C15	Créditos y depósitos en otras instituciones financieras del país	Mensual	9
C16	Ingresos y gastos por servicios con el exterior	Mensual	9
C17	Posiciones externas y locales	Trimestral	12
C40	Flujos asociados a los riesgos de tasa de interés y reajustabilidad en el libro de banca. (2)	Mensual	9
C41	Información semanal sobre riesgos de mercado según metodología estandarizada (2)	Semanal	3
C42	Información mensual sobre riesgos de mercado según metodología estandarizada	Mensual	9
C43	Información consolidada sobre riesgos de mercado según metodología estandarizada	Mensual	9

- (1) El archivo C08 semanal incluye información individual referida a los días 8, 16, 24 y último día de cada mes, en tanto que el mensual incluye información consolidada referida al último día de cada mes.
- (2) Los archivos C40 y C41 sustituirán en su momento a los archivos C05, C07 y C09.

**SISTEMA DEUDORES**

<b>Código</b>	<b>NOMBRE</b>	<b>Periodicidad</b>	<b>Plazo</b> (días hábiles)
D01	Deudas Generales	Mensual	7
D02	Deudas Específicas	Mensual	7
D04	Captaciones	Mensual	10
D05	Deudores de operaciones transfronterizas	Mensual	10
D08	Créditos de consumo e hipotecarios para vivienda	Mensual	7
D09	Cartas de Garantía Interbancarias	Mensual	7
D16	Garantías constituidas (1)	Trimestral	10
D17	Personas con garantías constituidas (1)	Trimestral	10
D21	Contratos de leasing	Mensual	7
D22	Bienes en leasing	Mensual	7
D23	Garantías de leasing	Mensual	7
D24	Operaciones de factoraje	Mensual	12
D25	Créditos relacionados otorgados por filiales y sucursales en el exterior	Mensual	12
D26	Créditos otorgados por sucursales en el exterior	Mensual	15
D30	Tasas de interés de operaciones asociadas al cálculo de interés corriente	Diario	1 (2)
D31	Tasas de interés diarias para operaciones activas y pasivas	Diario	1 (2)
D40	Créditos para exportaciones exentos de impuesto	Mensual	12
D50	Acreedores financieros	Mensual	10

- (1) Los archivos D16 y D17 rigen a contar del 30 de junio de 2005.
- (2) Entregar en el curso de la mañana del día hábil bancario siguiente.

**SISTEMA PRODUCTOS**

<b>Código</b>	<b>NOMBRE</b>	<b>Periodicidad</b>	<b>Plazo</b> (días hábiles)
P01	Movimiento de Cheques	Mensual	9
P02	Cuentas Corrientes	Mensual	9
P03	Composición Institucional de las Captaciones	Mensual	9
P07	Depósitos a Plazo	Mensual	9
P10	Cuentas de Depósito a la Vista y a Plazo	Mensual	9
P14	Estado de las Colocaciones	Mensual	9
P15	Composición Institucional de las Colocaciones	Mensual	9
P16	Colocaciones por actividad económica	Mensual	9
P17	Inversiones Financieras	Mensual	9
P18	Letras y Pagarés	Mensual	9
P19	Ahorro para la Vivienda	Trimestral	9
P20	Operaciones en Cajeros Automáticos (1)	Mensual	9
P21	Deudores en Cuentas Corrientes	Mensual	9
P22	Otros Productos de Colocaciones	Mensual	9
P23	Tasas de Productos	Mensual	9
P24	Tarifas de Productos	Trimestral	9
P25	Tarjetas de Crédito. Distribución por Vencimiento (2)	Mensual	9
P26	Tarjetas de Crédito. Distribución por Morosidad (2)	Mensual	9
P27	Tarjetas de Créditos. Utilización de Líneas de Crédito (3)	Mensual	9
P28	Tarjetas de Débito	Mensual	9
P30	Colocaciones en Letras de Crédito y Mutuos Hipotecarios Endosables	Mensual	9
P31	Operaciones realizadas en el mes con Letras de Crédito y Mutuos Hipotecarios Endosables	Mensual	9
P32	Servicios prestados a través de internet (3)	Semestral	20
P33	Ahorro previsional voluntario	Mensual	9
P34	Trasposos de ahorro previsional voluntario	Mensual	9
P35	Tipo de depositante de ahorro previsional voluntario	Mensual	9
P36	Estado de emisiones y colocaciones de bonos	Mensual	9

- (1) No deben enviar este archivo las instituciones financieras que proporcionen la misma información a través de Redbanc.
- (2) No deben enviar este archivo las instituciones financieras que proporcionen la misma información a través de la respectiva empresa operadora de tarjetas de crédito.
- (3) Este archivo lo enviarán sólo aquellas instituciones que tenga un sitio Web.

**SISTEMA INSTITUCIONES**

<b>Código</b>	<b>NOMBRE</b>	<b>Periodicidad</b>	<b>Plazo</b> (días hábiles)
I01	Accionistas	Trimestral	6
I02	Grupos Relacionados	Bimestral	3
I03	Directores, Apoderados Generales y Personas Relacionadas con ellos	Bimestral	3
I04	Personal, Oficinas y Cajeros Automáticos	Mensual	6
I05	Gravámenes sobre Acciones	Trimestral	6

**SISTEMA ESTADISTICO**

<b>Código</b>	<b>NOMBRE</b>	<b>Periodicidad</b>	<b>Plazo</b> (días hábiles)
E01	Remate de garantías en Créditos para la Vivienda	Semestral	7
E02	Bienes Recibidos o Adjudicados en Pago	Trimestral	7
E03	Venta de Bienes Recibidos a Adjudicados en Pago	Trimestral	7
E05	Estado de Gastos a Favor de Empresas y Personas Relacionadas	Trimestral	7

**CODIGO** : C40

**NOMBRE** : FLUJOS ASOCIADOS A LOS RIESGOS DE TASA DE INTERES Y DE REAJUSTABILIDAD EN EL LIBRO DE BANCA

**SISTEMA** : Contable

**PERIODICIDAD** : Mensual

**PLAZO** : 9 días hábiles

*En este archivo se informarán los flujos calculados al último día de cada mes, para el cómputo de la relación de operaciones activas y pasivas, según la metodología de que trata el Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile y el Capítulo 12-9 de la Recopilación Actualizada de Normas.*

---

**PRIMER REGISTRO**

1. Código de la institución financiera .....	9(03)
2. Identificación del archivo.....	X(03)
3. Período.....	P(06)
4. Filler.....	X(14)
	Largo del registro
	26 bytes

1. CODIGO DE LA IF.  
Corresponde a la identificación de la institución financiera según la codificación dada por esta Superintendencia.
2. IDENTIFICACION DEL ARCHIVO.  
Corresponde a la identificación del archivo. Debe ser "C40".
3. PERIODO.  
Corresponde al mes (AAAAMM) a que se refiere la información.

**REGISTROS SIGUIENTES**

Los registros siguientes contendrán información de distinta índole, por lo cual en el primer campo de cada registro se identificará de qué información se trata, según los siguientes códigos:

<u>Código</u>	<u>Tipo de registro (contenido)</u>
01	Patrimonio efectivo.
02	Margen.

- 03 Exposición de corto plazo al riesgo de tasa de interés.
- 04 Exposición al riesgo de reajustabilidad.
- 05 Menor ingreso por comisiones sensible a las tasas de interés.
- 06 Exposición de largo plazo al riesgo de tasa de interés.
- 07 Exposición al riesgo de opciones sobre tasas de interés.
- 08 Límites.
- 09 Detalle de flujos asignables a las bandas temporales.
- 10 Detalle de comisiones sensibles a las tasas de interés.
- 11 Detalle de opciones sobre tasas de interés.
- 12 Detalle de exposiciones al riesgo de reajustabilidad.

**Registro para indicar el patrimonio efectivo:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Patrimonio efectivo .....	9(14)
3. Filler.....	X(10)
Largo del registro	26 bytes

- 1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "01".
- 2. PATRIMONIO EFECTIVO.  
Monto del patrimonio efectivo correspondiente al día a que se refiere la información.

**Registro para indicar el margen:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Margen .....	9(14)
3. Filler.....	X(10)
Largo del registro	26 bytes

- 1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "02".
- 2 - MARGEN.  
Corresponde a la diferencia entre los ingresos y gastos por intereses y reajustes acumulados en los últimos 12 meses, más los ingresos netos por aquellas comisiones sensibles a la tasa de interés a que se refiere el numeral 1.3 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile, acumulados en los últimos doce meses.

**Registro para indicar la exposición al riesgo de tasa de interés del Libro de Banca:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Exposición de corto plazo al riesgo de tasa de interés en el Libro de Banca.....	9(14)
3. Filler.....	X(10)
Largo del registro	26 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "03".
  
2. EXPOSICION DE CORTO PLAZO AL RIESGO DE TASA DE INTERES EN EL LIBRO DE BANCA.  
Corresponde al resultado obtenido al aplicar el primer término de la primera ecuación indicada en el numeral 1.2 del Anexo 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile, considerando las precisiones contenidas en los numerales 1.3 y 3 de dicho anexo y en el Capítulo 12-9 de la Recopilación Actualizada de Normas.

**Registro para indicar la exposición al riesgo de reajustabilidad en el Libro de Banca:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Exposición al riesgo de reajustabilidad en el Libro de Banca.....	9(14)
3. Filler.....	X(10)
Largo del registro	26 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "04".
  
2. EXPOSICION AL RIESGO DE REAJUSTABILIDAD EN EL LIBRO DE BANCA.  
Corresponde al resultado obtenido al aplicar el segundo término de la primera ecuación indicada en el numeral 1.2 Anexo 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile, considerando lo dispuesto en los numerales 1.3 y 3 de dicho anexo y las precisiones contenidas en el Capítulo 12-9 de la Recopilación Actualizada de Normas.

**Registro para indicar el menor ingreso por comisiones sensible a las tasas de interés:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Menor ingreso por comisiones sensible a las tasas de interés.....	9(14)
3. Filler.....	X(10)
Largo del registro	26 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "05".
  
2. MENOR INGRESO POR COMISIONES SENSIBLE A LAS TASAS DE INTERES.  
Corresponde al tercer término de la primera ecuación indicada en el numeral 1.2 del Anexo 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile, considerando lo dispuesto en el número iii) del numeral 1.3 de dicho anexo y las precisiones del Capítulo 12-9 de la Recopilación Actualizada de Normas.

**Registro para indicar la exposición de largo plazo al riesgo de tasa de interés en el Libro de Banca:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Exposición de largo plazo al riesgo de tasa de interés en el Libro de Banca.....	9(14)
3. Filler.....	X(10)
Largo del registro	26 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "06".
  
2. EXPOSICION DE LARGO PLAZO AL RIESGO DE TASA DE INTERES EN EL LIBRO DE BANCA.  
Corresponde al resultado obtenido al aplicar la segunda ecuación indicada en el numeral 1.2 del Anexo 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile.

**Registro para indicar la exposición de opciones sobre tasas de interés en el Libro de Banca:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Exposición al riesgo de opciones sobre tasas de interés en el Libro de Banca.....	9(14)
3. Filler.....	X(10)
Largo del registro	26 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "07".
2. EXPOSICION AL RIESGO DE OPCIONES SOBRE TASAS DE INTERES EN EL LIBRO DE BANCA.  
Corresponde a la exposición al riesgo de mercado de las posiciones en opciones sobre tasas de interés en el Libro de Banca, calculada según lo dispuesto en el numeral 4.1 ó 4.2 del Anexo 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central, según corresponda, considerando lo indicado en el numeral 3 de dicho anexo.

**Registro para indicar los límites a las exposiciones de corto y largo plazo:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Límite a la exposición de corto plazo a los riesgos de tasas de interés y de reajustabilidad en el Libro de Banca.....	9(03)V9(01)
3. Límite a la exposición de largo plazo al riesgo de tasas de interés en el Libro de Banca.....	9(03)V9(01)
4. Filler.....	X(16)
Largo del registro	26 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "08".
2. LIMITE A LA EXPOSICION DE CORTO PLAZO A LOS RIESGOS DE TASAS DE INTERES Y DE REAJUSTABILIDAD EN EL LIBRO DE BANCA.  
La exposición de corto plazo a los riesgos de tasas de interés y de reajustabilidad en el Libro de Banca debe medirse conforme lo indicado en la primera ecuación del numeral 1.2 del Anexo 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile. El límite que haya sido fijado para dicha exposición debe informarse como un porcentaje de la diferencia entre los ingresos y gastos por intereses y reajustes acumulados más los ingresos netos por comisiones sensibles a la tasa de interés a que se refiere dicho anexo, acumulados en los últimos doce meses.

3. LIMITE A LA EXPOSICION DE LARGO PLAZO AL RIESGO DE TASAS DE INTERES EN EL LIBRO DE BANCA.

La exposición de largo plazo al riesgo de tasas de interés en el Libro de Banca debe medirse conforme lo indicado en la segunda ecuación del numeral 1.2 del Anexo 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile, incluyendo el riesgo de opciones sobre tasas de interés o instrumentos de deuda en el Libro de Banca. El límite que se haya fijado para dicha exposición debe informarse como un porcentaje del patrimonio efectivo.

**Registros para el cálculo del riesgo de tasas de interés en el Libro de Banca:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Tipo de tasa de interés.....	9(01)
3. Tipo de flujo informado.....	9(01)
4. Moneda.....	9(03)
5. Origen del flujo.....	9(03)
6. Banda temporal.....	9(02)
7. Monto del flujo.....	9(14)
Largo del registro	26 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "09".

2. TIPO DE TASA DE INTERES.  
Se identificará con los siguientes códigos:

<u>Código</u>	<u>Tipo de tasa</u>
1	Para operaciones con tasas fijas y saldos no sujetos a interés
2	Para operaciones con tasa flotante

3. TIPO DE FLUJO INFORMADO.  
Se utilizarán los siguientes códigos para identificar los flujos que se informan:

<u>Código</u>	<u>Tipo de flujo</u>
1	Para los flujos de capital
2	Para los flujos de intereses

4. MONEDA.

Corresponde al código de moneda extranjera de pago o tipo de reajustabilidad según la Tabla 1. Para operaciones pagaderas en pesos reajustables en moneda extranjera (incluidas las expresadas en moneda extranjera y pagaderas en pesos), se utilizará el código correspondiente a la moneda extranjera de que se trate y no el código que identifica el tipo de reajustabilidad.

5. ORIGEN DEL FLUJO.

Se utilizarán los siguientes códigos:

<u>Código</u>	<u>Origen de los flujos</u>
	<i>Para el disponible:</i>
001	Disponible
	<i>Para colocaciones no asociadas al uso de líneas de crédito y de sobregiros:</i>
111	Créditos comerciales (excluidos los indicados en los códigos siguientes)
112	Compras con pacto de reventa
119	Operaciones de leasing comercial
121	Créditos hipotecarios de vivienda en letras de crédito
122	Créditos hipotecarios de vivienda con mutuos hipotecarios endosables
123	Otros créditos hipotecarios de vivienda
129	Leasing para vivienda
131	Créditos de consumo
139	Leasing de consumo
	<i>Para colocaciones asociadas al uso de líneas de crédito y de sobregiros:</i>
211	Créditos comerciales
231	Créditos de consumo
	<i>Para instrumentos financieros no derivados</i>
301	Banco Central de Chile
302	Gobierno de Chile
303	Bancos e instituciones financieras del país
304	Otras entidades del país
305	Gobiernos y entidades gubernamentales extranjeros
306	Bancos del exterior
307	Otras entidades extranjeras
	<i>Para posiciones activas en derivados:</i>
351	Forwards
352	Futuros
353	Swaps
354	Otros, excepto opciones
	<i>Para otros activos</i>
390	Otros activos

	<i>Para depósitos y captaciones:</i>
401	Depósitos a la vista
403	Depósitos a plazo
404	Cuentas de ahorro con giro diferido
405	Cuentas de ahorro con giro incondicional
409	Ventas con pacto de recompra
	<i>Para préstamos y otras obligaciones</i>
420	Préstamos y otras obligaciones contraídas en el país
425	Préstamos y otras obligaciones contraídas en el exterior
	<i>Para instrumentos de deuda emitidos</i>
431	Letras de crédito
432	Bonos corrientes
433	Bonos subordinados
	<i>Para posiciones pasivas en derivados:</i>
451	Forwards
452	Futuros
453	Swaps
454	Otros, excepto opciones
	<i>Para otros pasivos</i>
490	Otros pasivos
	<i>Para posiciones delta ponderada de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda:</i>
601	Posición delta ponderada activa de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (método intermedio) - Libro de Banca.
602	Posición delta ponderada pasiva de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (método intermedio) - Libro de Banca.

Los códigos correspondientes a colocaciones incluyen tanto las vigentes como las vencidas.

Los instrumentos financieros no derivados corresponden a instrumentos no derivados incluidos en el Libro de Banca.

Con el código "401" se informarán las acreencias a la vista por concepto de depósitos, cuentas de ahorro y otras obligaciones, en tanto que con el código "403" se incluirán las acreencias a plazo con excepción de las indicadas con otros códigos.

Los códigos "351" a "354" y "451" a "454" se refieren a derivados, excepto opciones, incluidos en el Libro de Banca. Deberán ser separados en los flujos asociados a los subyacentes respectivos y asignados a las bandas temporales que correspondan.

La posición delta ponderada de opciones sobre tasas de interés o instrumentos de deuda (Códigos "601" o "602") corresponde a opciones sobre tasas de interés o instrumentos de deuda, incluidas en el Libro de Banca. Debe ser computada conforme lo indicado en el numeral 4.2.1 del Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile.

6. BANDA TEMPORAL.

Se utilizarán los códigos que se indican para identificar las bandas temporales correspondientes a la Tabla 2 del Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile, las que informarán los flujos según su vencimiento:

<u>Código</u>	<u>Banda temporal (plazos)</u>
01	Disponible hasta 1 mes
02	1-3 meses
03	3-6 meses
04	6-9 meses
05	9 meses - 1 año
06	1-2 años
07	2-3 años
08	3-4 años
09	4-5 años
10	5-7 años
11	7-10 años
12	10-15 años
13	15-20 años
14	más de 20 años

7. MONTO DEL FLUJO

Se debe informar el monto que corresponda de acuerdo con los campos anteriores.

**Registros para el cálculo del menor ingreso neto por comisiones sensibles a cambios en las tasas de interés:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Moneda.....	9(03)
3. Origen de la comisión.....	9(01)
4. Monto neto de la comisión.....	9(14)
5. Filler.....	X(06)
	Largo del registro
	26 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.

Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "10".

2. MONEDA.

Corresponde al código de moneda extranjera de pago o tipo de reajustabilidad según la Tabla 1. Para operaciones pagaderas en pesos reajustables en moneda extranjera (incluidas las expresadas en moneda extranjera y pagaderas en pesos), se utilizará el código correspondiente a la moneda extranjera de que se trate y no el código que identifica el tipo de reajustabilidad.

3. ORIGEN DE LA COMISION.

Identifica si las comisiones sensibles a cambios en la tasa de interés a que se refiere el Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile guardan relación con operaciones activas o pasivas, según:

<u>Código</u>	<u>Origen de la comisión</u>
1	Operaciones activas
2	Operaciones pasivas

4. MONTO NETO DE LA COMISION

Se debe informar el monto neto que corresponda de acuerdo con los campos anteriores.

**Registros para el cálculo del riesgo de opciones sobre tasas de interés (exclusive delta ponderado) en el Libro de Banca:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Tipo de tasa de interés.....	9(01)
3. Moneda.....	9(03)
4. Componente del riesgo de opciones.....	9(01)
5. Monto de la exposición.....	9(14)
6. Filler.....	X(05)
	Largo del registro
	26 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.

Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "11".

2. TIPO DE TASA DE INTERES.

Se identificará con los siguientes códigos:

<u>Código</u>	<u>Tipo de tasa</u>
1	Para operaciones con tasas fijas
2	Para operaciones con tasa flotante

3. MONEDA.

Corresponde al código de moneda extranjera de pago o tipo de reajustabilidad según la Tabla 1. Para operaciones pagaderas en pesos reajustables en moneda extranjera (incluidas las expresadas en moneda extranjera y pagaderas en pesos), se utilizará el código correspondiente a la moneda extranjera de que se trate y no el código que identifica el tipo de reajustabilidad.

4. COMPONENTE DEL RIESGO DE OPCIONES.

Se utilizarán los siguientes códigos:

<u>Código</u>	<u>Componente</u>
1	Riesgo gamma de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (método intermedio)
2	Riesgo vega de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (método intermedio)
3	Exposición de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (método simplificado)

El riesgo gamma de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda corresponde a los impactos gamma de las opciones sobre tasas de interés o instrumentos de deuda incluidas en el Libro de Banca, calculados conforme lo indicado en el numeral 4.2.2 Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile.

El riesgo vega de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda corresponde a los impactos vega de opciones sobre tasas de interés o instrumentos de deuda incluidas en el Libro de Banca, calculados conforme lo indicado en el numeral 4.2.3 Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile.

La exposición de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (método simplificado) corresponde al riesgo de mercado de posiciones largas en opciones sobre tasas de interés o instrumentos de deuda incluidas en Libro de Banca, calculada conforme lo indicado en el numeral 4.1 Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile.

5. MONTO DE LA EXPOSICION.

Se debe informar el monto que corresponda de acuerdo con los campos anteriores.

**Registros para el cálculo del riesgo de reajustabilidad en el Libro de Banca:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Origen de la exposición.....	9(02)
3. Monto de la exposición.....	9(14)
4. Filler.....	X(08)
Largo del registro	26 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "12".

2. ORIGEN DE LA EXPOSICION.  
Identifica el origen de la exposición al riesgo de reajustabilidad, por aquellas posiciones en el Libro de Banca en moneda chilena reajutable (UF, IVP, UTM o IPC, tratadas como una sola moneda), como asimismo los saldos sujetos a corrección monetaria computables. Se utilizarán los siguientes códigos:

<u>Código</u>	<u>Tipo de flujo</u>
01	Activos reajustables (incluida posiciones en derivados sobre UF)
02	Pasivos reajustables (incluida posiciones en derivados sobre UF)
03	Activo fijo e inversiones en sociedades
04	Capital pagado y reservas sujetas a corrección monetaria.

El código "01" incluye todos los activos reajustables correspondientes al Libro de Banca, incluidas las posiciones activas en derivados sobre UF del Libro de Banca.

El código "02" incluye todos los pasivos reajustables, incluidas las posiciones pasivas en derivados sobre UF del Libro de Banca.

Los códigos "03" y "04" identifican los saldos sujetos a corrección monetaria computables de acuerdo con lo indicado en el Capítulo 12-9 de la Recopilación Actualizada de Normas.

3. MONTO DE LA EXPOSICION.  
Se debe informar el monto que corresponda de acuerdo con los campos anteriores. Al tratarse de posiciones activas o pasivas en derivados, debe informarse el valor razonable de las posiciones.

**Carátula de cuadratura**

El archivo C40 debe entregarse con una carátula de cuadratura cuyo modelo se especifica a continuación.

MODELO

Institución \_\_\_\_\_ Código: \_\_\_\_\_

Información correspondiente al mes de: \_\_\_\_\_ Archivo C40

Número de registros informados	
Número de registros con código 09 en su primer campo	
Número de registros con código 10 en su primer campo	
Número de registros con código 11 en su primer campo	
Número de registros con código 12 en su primer campo	
Suma campo 7 de registros con código 09 en su primer campo	
Suma campo 4 de registros con código 10 en su primer campo	
Suma campo 5 de registros con código 11 en su primer campo	
Suma campo 3 de registros con código 12 en su primer campo	

Responsable: \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_  
GERENTE

Fono: \_\_\_\_\_

**CODIGO** : C41

**NOMBRE** : INFORMACION SEMANAL SOBRE RIESGOS DE MERCADO SEGUN METODOLOGIA ESTANDARIZADA.

**SISTEMA** : Contable.

**PERIODICIDAD** : Semanal, referida a cada uno de los días hábiles bancarios de la semana anterior a la fecha de envío.

**PLAZO** : 3 días hábiles (tercer día hábil de la semana siguiente).

*En este archivo se informarán los flujos para el cómputo de la relación de operaciones activas y pasivas, según medición estándar, de que trata el Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile y el Capítulo 12-9 de la Recopilación Actualizada de Normas.*

El archivo deben enviarlo solamente los bancos que no utilizan modelos propios para fines de determinar el límite normativo de que trata el numeral 2.6 del Capítulo III.B.2 antes mencionado, incluyendo la información diaria de lunes a viernes, con excepción de los feriados.

**PRIMER REGISTRO**

1. Código de la institución financiera .....	9(03)
2. Identificación del archivo.....	X(03)
3. Fecha para identificación del archivo.....	F(08)
4. Filler.....	X(20)
Largo del registro	34 bytes

1. CODIGO DE LA IF.  
Corresponde a la identificación de la institución financiera según la codificación dada por esta Superintendencia.
2. IDENTIFICACION DEL ARCHIVO.  
Corresponde a la identificación del archivo. Debe ser "C41".
3. FECHA DE IDENTIFICACION DEL ARCHIVO.  
Corresponde a la fecha del último día hábil de la semana cuya información diaria se informa (última fecha a la que se refiere la información).

**REGISTROS SIGUIENTES**

Los registros siguientes contendrán información de distinta índole, por lo cual en el primer campo de cada registro se identificará de qué información se trata, según los siguientes códigos:

<u>Código</u>	<u>Tipo de registro (contenido)</u>
01	Patrimonio efectivo.
02	Activos ponderados por riesgo.
03	Exposición al riesgo de tasa de interés del Libro de Negociación.
04	Exposición al riesgo de moneda en el Libro de Negociación y en el Libro de Banca.
05	Riesgo de opciones sobre tasa de interés en el Libro de Negociación.
06	Riesgo de opciones sobre monedas en el Libro de Negociación y en el Libro de Banca.
07	Detalle de flujos asignables a bandas temporales.
08	Detalle de opciones sobre tasas de interés.
09	Detalle de exposiciones en monedas.

Por otra parte, en el segundo campo de cada uno de los registros se incluirá la fecha a la cual se refiere la información que contiene el registro.

**Registros para indicar el patrimonio efectivo:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Fecha.....	F(08)
3. Patrimonio efectivo.....	9(14)
4. Filler.....	X(10)
	Largo del registro
	34 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "01".
  
2. FECHA.  
Corresponde a la fecha a la cual se refiere la información del registro.

3 PATRIMONIO EFECTIVO:

Monto del patrimonio efectivo correspondiente a la fecha indicada en el campo anterior. Dado que el monto del patrimonio efectivo depende de ajustes contables que normalmente se efectúan al cierre de cada mes (corrección monetaria y provisiones), si el banco no dispone de los medios para estimar los montos correspondientes a cada día, podrá incluir los de la última información mensual disponible. No obstante, las variaciones del patrimonio efectivo que obedezcan a aumentos de capital, reparto de dividendos o remesas de utilidades, deberán considerarse a partir del día en que se originen.

**Registros para indicar el monto de los activos ponderados por riesgo:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Fecha.....	F(08)
3. Activos ponderados por riesgo.....	9(14)
4. Filler.....	X(10)
Largo del registro	34 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.

Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "02".

2. FECHA.

Corresponde a la fecha a la cual se refiere la información del registro.

3. ACTIVOS PONDERADOS POR RIESGO.

Corresponde al monto de los activos ponderados por riesgo según lo indicado en el Capítulo 12-1 de la Recopilación Actualizada de Normas, correspondiente al día indicado en el campo anterior. Dado que el monto de los activos ponderados por riesgo depende de ajustes contables que normalmente se efectúan al cierre de cada mes (provisiones), si el banco no dispone de los medios para estimar los montos correspondientes a cada día, podrá incluir en los respectivos registros los de la última información mensual disponible.

**Registros para indicar la exposición al riesgo de tasa de interés en el Libro de Negociación:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Fecha.....	F(08)
3. Exposición al riesgo de tasa de interés en el Libro de Negociación.....	9(14)
4. Filler.....	X(10)
Largo del registro	34 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "03".
2. FECHA.  
Corresponde a la fecha a la cual se refiere la información del registro.
- 3 EXPOSICION AL RIESGO DE TASAS DE INTERES EN EL LIBRO DE NEGOCIACION.  
Corresponde al resultado obtenido conforme lo indicado en el numeral 1.1 del Anexo N°1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile, considerando lo dispuesto en el numeral 3 de dicho anexo y en el Capítulo 12-9 de la Recopilación Actualizada de Normas.

**Registros para indicar la exposición al riesgo de moneda en el Libro de Negociación y en el Libro de Banca:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Fecha.....	F(08)
.3. Exposición al riesgo de moneda en el Libro de Negociación y en el Libro de Banca.....	9(14)
4. Filler.....	X(10)
Largo del registro	34 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "04".
2. FECHA.  
Corresponde a la fecha a la cual se refiere la información del registro.
- 3 EXPOSICION AL RIESGO DE MONEDAS EN EL LIBRO DE NEGOCIACION Y EN EL LIBRO DE BANCA.  
Corresponde al resultado obtenido conforme lo indicado en el numeral 2 del Anexo N° 1 Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile, considerando lo dispuesto en el numeral 3 de dicho anexo y en el Capítulo 12-9 de la Recopilación Actualizada de Normas.

**Registros para indicar el riesgo de opciones sobre tasa de interés en el Libro de Negociación:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Fecha.....	F(08)
3. Riesgo de opciones sobre tasas de interés en el Libro de Negociación.....	9(14)
2. Filler.....	X(10)
Largo del registro	34 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "05".
2. FECHA.  
Corresponde a la fecha a la cual se refiere la información del registro.
- 3 RIESGO DE OPCIONES SOBRE TASAS DE INTERES EN EL LIBRO DE NEGOCIACION.  
Corresponde a la exposición al riesgo de mercado de posiciones en opciones sobre tasas de interés incluidas en el Libro de Negociación. Dicha exposición debe calcularse conforme a lo indicado en los numerales 4.1 ó 4.2 del Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile, según corresponda.

**Registros para indicar el riesgo de opciones sobre monedas en el Libro de Negociación y en el Libro de Banca:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Fecha.....	F(08)
.3. Riesgo de opciones sobre monedas en el Libro de Negociación y en el Libro de Banca.....	9(14)
2. Filler.....	X(10)
Largo del registro	34 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "06".
2. FECHA.  
Corresponde a la fecha a la cual se refiere la información del registro.
- 3 RIESGO DE OPCIONES SOBRE MONEDAS EN EL LIBRO DE NEGOCIACION Y EN EL LIBRO DE BANCA.  
Corresponde a la exposición al riesgo de mercado de las posiciones en opciones sobre monedas en el Libro de Negociación y en el Libro de Banca, calculada según lo dispuesto en el numeral 4.1 ó 4.2 del Anexo 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile, según corresponda.

**Registros para el cálculo del riesgo de tasa de interés en el Libro de Negociación:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Fecha.....	F(08)
3. Tipo de tasa de interés.....	9(01)
4. Tipo de flujo informado.....	9(01)
5. Moneda.....	9(03)
6. Origen del flujo.....	9(03)
7. Banda temporal.....	9(02)
8. Monto del flujo.....	9(14)
Largo del registro	34 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "07".

2. FECHA.  
Corresponde a la fecha a la cual se refiere la información del registro.

3. TIPO DE TASA DE INTERES.  
Se identificará con los siguientes códigos:

<u>Código</u>	<u>Tipo de tasa</u>
1	Para operaciones con tasas fijas y saldos no sujetos a interés
2	Para operaciones con tasa flotante

4. TIPO DE FLUJO INFORMADO.  
Se utilizarán los siguientes códigos para identificar los flujos que se informan:

<u>Código</u>	<u>Tipo de flujo</u>
1	Para los flujos de capital
2	Para los flujos de intereses

5. MONEDA.  
Corresponde al código de moneda extranjera de pago o tipo de reajustabilidad según la Tabla 1. Para operaciones pagaderas en pesos reajustables en moneda extranjera (incluidas las expresadas en moneda extranjera y pagaderas en pesos), se utilizará el código correspondiente a la moneda extranjera de que se trate y no el código que identifica el tipo de reajustabilidad.

6. ORIGEN DEL FLUJO

Identifica el tipo de posición en el Libro de Negociación que origina los flujos. Se utilizarán los siguientes códigos:

<u>Código</u>	<u>Origen de los flujos</u>
	<i>Para instrumentos financieros no derivados:</i>
301	Banco Central de Chile
302	Gobierno de Chile
303	Bancos e instituciones financieras del país
304	Otras entidades del país
305	Gobiernos y entidades gubernamentales extranjeros
306	Bancos del exterior
307	Otras entidades extranjeras
	<i>Para posiciones activas en derivados:</i>
351	Forwards
352	Futuros
353	Swaps
354	Otros, excepto opciones
	<i>Para posiciones pasivas en derivados:</i>
451	Forwards
452	Futuros
453	Swaps
454	Otros, excepto opciones
	<i>Para posiciones delta ponderada de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda:</i>
603	Posición delta ponderada activa de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (método intermedio) - Libro de Negociación.
604	Posición delta ponderada pasiva de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (método intermedio) - Libro de Negociación.

Los instrumentos financieros no derivados corresponden sólo a aquellas posiciones en instrumentos no derivados registrados en el activo por su valor razonable que no presenten restricciones de ninguna naturaleza que puedan impedir que sean negociados y que: (i) se mantengan en cartera para negociarlos en el corto plazo con el propósito de obtener ganancias provenientes del arbitraje o de fluctuaciones esperadas en los precios o tasas de mercado; o que (ii) formen parte de una cartera de instrumentos que se negocian activa y frecuentemente por la institución.

Los códigos "351" a "354" y "451" a "454" se refieren a derivados, excepto opciones, incluidos en el Libro de Negociación. Deberán ser separados en los flujos asociados a los subyacentes respectivos y asignados a las bandas temporales que correspondan.

La posición delta ponderada de opciones sobre tasas de interés o instrumentos de deuda (Códigos "601" o "602") corresponde a la posición en opciones sobre tasas de interés o instrumentos de deuda, incluidas en el Libro de Negociación. Debe ser computada conforme lo indicado en el numeral 4.2.1 del Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile.

7. BANDA TEMPORAL.

Se utilizarán los códigos que se indican para identificar las bandas temporales correspondientes a la Tabla 2 del Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile, las que informarán los flujos según su vencimiento:

<u>Código</u>	<u>Banda temporal (plazos)</u>
01	Disponible hasta 1 mes
02	1-3 meses
03	3-6 meses
04	6-9 meses
05	9 meses - 1 año
06	1-2 años
07	2-3 años
08	3-4 años
09	4-5 años
10	5-7 años
11	7-10 años
12	10-15 años
13	15-20 años
14	más de 20 años

8. MONTO DEL FLUJO

Se debe informar el monto que corresponda de acuerdo con los campos anteriores.

**Registros para el cálculo del riesgo de opciones sobre tasa de interés (exclusive delta ponderado) en el Libro de Negociación:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Fecha.....	F(08)
3 Tipo de tasa de interés.....	9(01)
4. Moneda.....	9(03)
5. Componente del riesgo de opciones.....	9(01)
6. Monto de la exposición.....	9(14)
7. Filler.....	9(05)
Largo del registro	34 bytes

1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "08".
2. FECHA.  
Corresponde a la fecha a la cual se refiere la información del registro.
3. TIPO DE TASA DE INTERES.  
Se identificará con los siguientes códigos:

<u>Código</u>	<u>Tipo de tasa</u>
1	Para operaciones con tasas fijas y saldos no sujetos a interés
2	Para operaciones con tasa flotante

4. MONEDA.  
Corresponde al código de moneda extranjera de pago o tipo de reajustabilidad según la Tabla 1. Para operaciones pagaderas en pesos reajustables en moneda extranjera (incluidas las expresadas en moneda extranjera y pagaderas en pesos), se utilizará el código correspondiente a la moneda extranjera de que se trate y no el código que identifica el tipo de reajustabilidad.
5. COMPONENTE DEL RIESGO DE OPCIONES.  
Se utilizarán los siguientes códigos:

<u>Código</u>	<u>Componente</u>
1	Riesgo gamma de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (método intermedio).
2	Riesgo vega de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (método intermedio)
3	Exposición de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (método simplificado).

El riesgo gamma de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (Código "1") corresponde a los impactos gamma de las opciones sobre tasas de interés o instrumentos de deuda incluidas en el Libro de Banca, calculados conforme lo indicado en el numeral 4.2.2 Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile.

El riesgo vega de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (Código "2") corresponde a los impactos vega de opciones sobre tasas de interés o instrumentos de deuda incluidas en el Libro de Banca, calculados conforme lo indicado en el numeral 4.2.3 Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile.

La exposición de opciones sobre tasas de interés e instrumentos de deuda (Código "3") corresponde al riesgo de mercado de posiciones largas en opciones sobre tasas de interés o instrumentos de deuda incluidas en Libro de Banca, calculada conforme lo indicado en el numeral 4.1 Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile.

- 6. MONTO DE LA EXPOSICION.  
Se debe informar el monto que corresponda de acuerdo con los campos anteriores.

**Registros para el cálculo del riesgo de moneda en los libros de negociación y de banca:**

1. Tipo de registro.....	9(02)
2. Fecha.....	F(08)
3 Moneda extranjera.....	9(03)
4. Origen de la exposición.....	9(03)
5. Monto de la exposición.....	9(14)
6. Filler.....	9(04)
Largo del registro	34 bytes

- 1. TIPO DE REGISTRO.  
Corresponde al código que identifica el tipo de registro. Debe ser "09".
- 2. FECHA.  
Corresponde a la fecha a la cual se refiere la información del registro.
- 3. MONEDA EXTRANJERA.  
Corresponde a código de moneda extranjera según Tabla 1. Para operaciones pagaderas en pesos reajustables en moneda extranjera (incluidas las expresadas en moneda extranjera y pagaderas en pesos), se utilizará el código correspondiente a la moneda extranjera de que se trate y no el código que identifica el tipo de reajustabilidad. Para informar el Capital D.L 600 y las utilidades remesables D.L. 600, se incluirá el código de la moneda en que se realizaron los aportes de capital.
- 4. ORIGEN DE LA EXPOSICION.  
Identifica el tipo de exposición en moneda extranjera en el Libro de Negociación y en Libro de Banca. Se utilizarán los siguientes códigos:

<u>Código</u>	<u>Origen de la exposición</u>
	<i>Para el disponible:</i>
001	Disponible

	<i>Para colocaciones no asociadas al uso de líneas de crédito y de sobregiros:</i>
111	Créditos comerciales (excluidos los indicados en los códigos siguientes)
112	Compras con pacto de reventa
119	Operaciones de leasing comercial
121	Créditos hipotecarios de vivienda en letras de crédito
122	Créditos hipotecarios de vivienda con mutuos hipotecarios endosables
123	Otros créditos hipotecarios de vivienda
129	Leasing para vivienda
131	Créditos de consumo
139	Leasing de consumo
	<i>Para colocaciones asociadas al uso de líneas de crédito y de sobregiros:</i>
211	Créditos comerciales
231	Créditos de consumo
	<i>Para instrumentos financieros no derivados</i>
301	Banco Central de Chile
302	Gobierno de Chile
303	Bancos e instituciones financieras del país
304	Otras entidades del país
305	Gobiernos y entidades gubernamentales extranjeros
306	Bancos del exterior
307	Otras entidades extranjeras
	<i>Para posiciones activas en derivados:</i>
351	Forwards
352	Futuros
353	Swaps
354	Otros, excepto opciones
	<i>Para otros activos</i>
390	Otros activos
	<i>Para depósitos y captaciones:</i>
401	Depósitos a la vista
403	Depósitos a plazo
404	Cuentas de ahorro con giro diferido
405	Cuentas de ahorro con giro incondicional
409	Ventas con pacto de recompra
	<i>Para préstamos y otras obligaciones</i>
420	Préstamos y otras obligaciones contraídas en el país
425	Préstamos y otras obligaciones contraídas en el exterior
	<i>Para instrumentos de deuda emitidos</i>
431	Letras de crédito
432	Bonos corrientes
433	Bonos subordinados

	<i>Para posiciones pasivas en derivados:</i>
451	Forwards
452	Futuros
453	Swaps
454	Otros, excepto opciones
	<i>Para otros pasivos</i>
490	Otros pasivos
	<i>Para exposición de opciones sobre monedas</i>
500	Exposición de opciones sobre monedas (método simplificado)
	<i>Para posiciones delta ponderada de opciones sobre monedas:</i>
701	Posición delta ponderada activa de opciones sobre monedas (método intermedio).
702	Posición delta ponderada pasiva de opciones sobre monedas (método intermedio)
	<i>Para riesgo gamma y vega</i>
801	Riesgo gamma de opciones sobre monedas (método intermedio).
802	Riesgo vega de opciones sobre monedas (método intermedio).
	<i>Para saldos D.L. 600</i>
901	Aportes de capital DL 600.
902	Utilidades retenidas remesables DL 600.

Los códigos correspondientes a colocaciones incluyen tanto las vigentes como las vencidas.

Los instrumentos financieros no derivados corresponden a la posición pagadera o reajutable en moneda extranjera en instrumentos financieros no derivados incluidos en el Libro de Negociación y en el Libro de Banca.

Con el código "401" se informarán las acreencias a la vista por concepto de depósitos, cuentas de ahorro y otras obligaciones, en tanto que con el código "403" se incluirán las acreencias a plazo con excepción de las indicadas con otros códigos.

Las posiciones en derivados (Códigos "351" a "354" y "451" a "454"), corresponden a las de derivados, excluidas las opciones, incluidos en el Libro de Negociación y en el Libro de Banca. Debe informarse el valor razonable de las posiciones.

La exposición de opciones sobre monedas (método simplificado) que se informa con el código "500", corresponde a la exposición en opciones sobre monedas extranjeras incluidas en el Libro de Negociación y en el Libro de Banca, calculada conforme lo indicado en el numeral 4.1 del Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile.

La posición delta ponderada de opciones sobre monedas (códigos "701" y "702") corresponde a la posición en opciones sobre monedas extranjeras incluidas en el Libro de Negociación y en el Libro de Banca, calculada conforme lo indicado en el numeral 4.2.1 del Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile.

El riesgo gamma de opciones sobre monedas (Código "801") corresponde a los impactos gamma de opciones sobre monedas extranjeras incluidas en el Libro de Negociación y en el Libro de Banca, calculados conforme lo indicado en el numeral 4.2.2 del Anexo N° 1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile.

El riesgo vega de opciones sobre monedas (Código "802") corresponde a los impactos vega de opciones sobre monedas extranjeras incluidas en el Libro de Negociación y en el Libro de Banca, calculados conforme lo indicado en el numeral 4.2.3 del Anexo N°1 del Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile.

5. MONTO DE LA EXPOSICION.

Se debe informar el monto que corresponda de acuerdo con los campos anteriores.

**Carátula de cuadratura**

El archivo C41 debe entregarse con una carátula de cuadratura cuyo modelo se especifica a continuación.

MODELO

Institución \_\_\_\_\_ Código: \_\_\_\_\_

Información correspondiente al mes de: \_\_\_\_\_ Archivo C41

Número de registros informados	
Número de registros con código 01 en su primer campo	
Número de registros con código 07 en su primer campo	
Número de registros con código 08 en su primer campo	
Número de registros con código 09 en su primer campo	
Suma campo 8 de registros con código 07 en su primer campo 1	
Suma campo 6 de registros con código 08 en su primer campo 1	
Suma campo 5 de registros con código 09 en su primer campo 1	

Responsable: \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_  
GERENTE

Fono: \_\_\_\_\_

**CODIGO** : C42

**NOMBRE** : INFORMACION MENSUAL SOBRE RIESGOS DE MERCADO SEGUN METODOLOGIA ESTANDARIZADA.

**SISTEMA** : Contable.

**PERIODICIDAD** : Mensual.

**PLAZO** : 9 días hábiles.

*En este archivo se informarán los flujos para el cómputo de la relación de operaciones activas y pasivas, según medición estándar, de que trata el Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile y el Capítulo 12-9 de la Recopilación Actualizada de Normas.*

*Este archivo deben enviarlo solamente los bancos que no utilizan la metodología estandarizada para la determinación del límite normativo, a fin de mostrar la situación sobre la base de esa metodología, referida al último día de cada mes.*

**PRIMER REGISTRO**

1. Código de la institución financiera .....	9(03)
2. Identificación del archivo.....	X(03)
3. Período.....	P(06)
4. Filler.....	X(22)
	Largo del registro
	34 bytes

1. CODIGO DE LA IF.  
Corresponde a la identificación de la institución financiera según la codificación dada por esta Superintendencia.
2. IDENTIFICACION DEL ARCHIVO.  
Corresponde a la identificación del archivo. Debe ser "C42".
3. PERIODO.  
Corresponde al mes (AAAAMM) al cual se refiere la información.

**REGISTROS SIGUIENTES**

Los registros siguientes corresponden a los instruidos para el **archivo C41**. En este caso la fecha incluida en el segundo campo de cada registro corresponderá a la del último día del mes que se informa.

**Carátula de cuadratura**

El archivo C42 debe entregarse con una carátula de cuadratura cuyo modelo se especifica a continuación.

MODELO

Institución \_\_\_\_\_ Código: \_\_\_\_\_

Información correspondiente al mes de: \_\_\_\_\_ Archivo C42

Número de registros informados	
Número de registros con código 07 en su primer campo	
Número de registros con código 08 en su primer campo	
Número de registros con código 09 en su primer campo	
Suma campo 8 de registros con código 07 en su primer campo 1	
Suma campo 6 de registros con código 08 en su primer campo 1	
Suma campo 5 de registros con código 09 en su primer campo 1	

Responsable: \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_  
GERENTE

Fono: \_\_\_\_\_

**CODIGO** : C43

**NOMBRE** : INFORMACION CONSOLIDADA SOBRE RIESGOS DE MERCADO SEGUN METODOLOGIA ESTANDARIZADA.

**SISTEMA** : Contable.

**PERIODICIDAD** : Mensual.

**PLAZO** : 9 días hábiles.

*En este archivo se informarán los flujos consolidados del banco con sus subsidiarias, referidos al último día de cada mes, para el cómputo de la relación de operaciones activas y pasivas, según medición estándar, de que trata el Capítulo III.B.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile y el Capítulo 12-9 de la Recopilación Actualizada de Normas.*

---

**PRIMER REGISTRO**

1. Código de la institución financiera .....	9(03)
2. Identificación del archivo.....	X(03)
3. Período.....	P(06)
4. Filler.....	X(22)
	34 bytes
Largo del registro	

1. CODIGO DE LA IF.  
Corresponde a la identificación de la institución financiera según la codificación dada por esta Superintendencia.
2. IDENTIFICACION DEL ARCHIVO.  
Corresponde a la identificación del archivo. Debe ser "C43".
3. PERIODO.  
Corresponde al mes (AAAAMM) al cual se refiere la información.

**REGISTROS SIGUIENTES**

Los registros siguientes corresponden a los instruidos para el **archivo C41**. En este caso la fecha incluida en el segundo campo de cada registro corresponderá a la del último día del mes que se informa.

**Carátula de cuadratura**

El archivo C43 debe entregarse con una carátula de cuadratura cuyo modelo se especifica a continuación.

MODELO

Institución \_\_\_\_\_ Código: \_\_\_\_\_

Información correspondiente al mes de: \_\_\_\_\_ Archivo C43

Número de registros informados	
Número de registros con código 07 en su primer campo	
Número de registros con código 08 en su primer campo	
Número de registros con código 09 en su primer campo	
Suma campo 8 de registros con código 07 en su primer campo 1	
Suma campo 6 de registros con código 08 en su primer campo 1	
Suma campo 5 de registros con código 09 en su primer campo 1	

Responsable: \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_  
GERENTE

Fono: \_\_\_\_\_