



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

Lima,

CIRCULAR N° AFP-

Ref.: Metodología de determinación de los códigos de instrumentos, intercambio de información y presentación del Informe Diario de Inversiones (IDI).

Señor
Gerente General:

Sírvase tomar conocimiento que, en uso de las atribuciones conferidas en la Ley General del Sistema Financiero y del Sistema de Seguros y Orgánica de la Superintendencia de Banca y Seguros, Ley N° 26702, en el inciso d) del artículo 57° del Texto Único Ordenado de la Ley del Sistema Privado de Administración de Fondos de Pensiones, aprobado por Decreto Supremo N° 054-97-EF y sus modificatorias, y la Tercera Disposición Final y Transitoria de su Reglamento, aprobado por Decreto Supremo N° 004-98-EF y sus modificatorias; y con la finalidad de establecer la metodología de determinación de los códigos de instrumento, el intercambio de información y los formatos de presentación del IDI, de acuerdo con lo señalado en los artículos 102° y 103° del Título VI del Compendio de Normas de Superintendencia Reglamentarias del Sistema Privado de Administración de Fondos de Pensiones, referido a inversiones, aprobado por Resolución N° 052-98-EF/SAFP y sus modificatorias; esta Superintendencia dispone lo siguiente:

1. Alcance.

La presente circular es aplicable al IDI de las Carteras Administradas correspondientes a cada uno de los fondos de aportes obligatorios o voluntarios administrados por las Administradoras Privadas de Fondos de Pensiones (AFP).

2. Información de la Superintendencia a la AFP.

La Superintendencia pone diariamente a disposición de la AFP lo siguiente:

- a) El vector de precios informando los precios aplicables a cada uno de los instrumentos u operaciones de inversión en que se invierten los recursos de las Carteras Administradas y los distintos tipos de cambio. La información es enviada a través del Portal del Supervisado u otro medio que la Superintendencia considere conveniente, de modo que esta información pueda ser incorporada en los respectivos sistemas de la AFP por medio del SPP red u otro medio electrónico, según lo determine la Superintendencia. Al respecto, la estructura de dicho archivo es la siguiente:

VPXXmmdd

Donde:

V: Sistema de inversiones

P: Módulo de precios

XX: Identificación de datos – P1 precios

mm: Mes del informe

dd: Día del informe



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

Archivos: VPP1mdd.

Longitud de registro: 80 caracteres.

Orden	Nombre	Edición	Descripción
1	COD_INS	X(12)	Código del instrumento
2	PRE_VAL	9(11)v9(07)	Precios del día
3	VAR_PRE	9(04)v9(07)	Variación de precio en porcentaje
4	SIG_VAR	X(01)	Signo de variación “+” ó “-”

- b) Los códigos de instrumento u operaciones de inversión: A este efecto, los códigos de instrumento a que se refiere el artículo 102° del Capítulo X del Título VI del Compendio de Normas de Superintendencia Reglamentarias del Sistema Privado de Administración de Fondos de Pensiones están compuestos por doce (12) caracteres alfanuméricos (sólo números y letras en mayúsculas) con la siguiente estructura:

VVEEEMRRRRR

Donde:

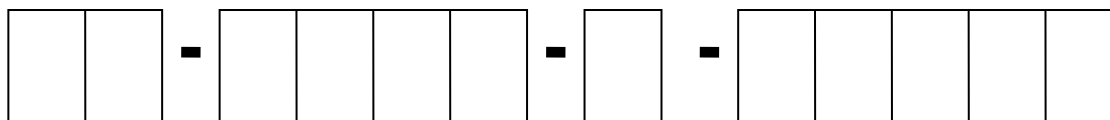
VV Código de título valor

EEEE Código de emisor del título valor

M Código de Moneda

RRRRR Código referencial

De esta manera, la estructura del Código de Instrumento se representará como:



**1. Código
Valor**

**2. Código de
Emisor**

**3. Código
Moneda**

**4. Código
Referencial**

- c) Otros códigos correspondientes a los Anexos que conforman el IDI: La Superintendencia comunica los códigos correspondientes para la transmisión electrónica de la información referida al indicador de movimiento, plaza de negociación, tipo de tasa, concepto (de cuentas por cobrar y cuentas por pagar), entre otros. Los sistemas de la AFP deben estar preparados para incorporar nuevos códigos respecto a la información antes referida.



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

3. Información de la AFP a la Superintendencia sobre códigos de instrumentos u operaciones de inversión, intermediarios, sistemas de negociación electrónica, *clearer brokers* y subyacentes de derivados.

Para la determinación de los códigos correspondientes a instrumentos u operaciones de inversión, intermediarios y sistemas de negociación electrónica, plazas de negociación, *clearer brokers* y subyacentes de derivados, la AFP debe seguir la metodología establecida en el Anexo A de la presente Circular, y remitir dichos códigos a la Superintendencia a través del Portal del Supervisado. La Superintendencia puede establecer un medio de envío alternativo para la remisión de los códigos en caso no sea posible utilizar el Portal del Supervisado.

En caso la Superintendencia verifique que la AFP ha aplicado incorrectamente la metodología en los códigos reportados, se procede a comunicar a la AFP de las discrepancias encontradas a efectos que sean subsanadas inmediatamente; en caso no haya discrepancia, los instrumentos u operaciones de inversión ingresan al vector de precios con los códigos reportados por la AFP, según lo establecido en el acápite 2.

La Superintendencia puede establecer mediante Oficio Múltiple nueva información necesaria para la codificación de instrumentos u operaciones de inversión que permita el registro de las inversiones de los fondos de pensiones en el Informe Diario de Inversiones.

4. Plazo de envío a la Superintendencia de la información sobre códigos de instrumentos u operaciones de inversión, intermediarios y sistemas de negociación electrónica nuevos.

La AFP debe tener en cuenta los siguientes plazos:

a. Codificación de intermediarios, sistemas de negociación electrónica, plazas de negociación, *clearer brokers* y subyacentes de derivados

La AFP debe remitir a la Superintendencia la información establecida en el acápite I del Anexo A como máximo el día anterior al inicio de las operaciones con los intermediarios, sistemas de negociación electrónica, plazas de negociación, *clearer brokers* y subyacentes de derivados.

b. Codificación del instrumento de inversión

La información requerida para la codificación de los instrumentos de inversión, establecida en el acápite II del Anexo A, debe ser remitida conforme a los siguientes plazos:

b.1. Oferta primaria

- Para los fondos mutuos o de inversión, locales o extranjeros, la información debe ser remitida hasta el mediodía (12:00 p.m.) del día siguiente a la fecha en la que la AFP es notificada de la adjudicación de las cuotas o participación del fondo.
- Para los demás instrumentos de inversión, la información debe ser remitida hasta el mediodía (12:00 p.m.) de la fecha de emisión de los valores. En caso la AFP decida negociar el instrumento entre las fechas de adjudicación y emisión de los valores (*when issue dealing*), la información debe ser remitida hasta el mediodía (12:00 p.m.) de la fecha de negociación de los valores.



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

b.2. Oferta secundaria

A más tardar hasta el mediodía (12:00 p.m.) de la fecha de adjudicación del instrumento de inversión.

Al respecto, en caso exista discrepancia entre la información alcanzada y la documentación sustentatoria, la Superintendencia comunica a la AFP de tal discrepancia a efectos de que sea subsanada hasta las 15:00 horas del día en que se recibe la información.

Asimismo, si la información se recibe de manera posterior a las horas establecidas en el literal b, se evaluará la inclusión del instrumento en el vector de precios a partir del día siguiente de la fecha de recepción de la información.

5. Información de la AFP a la Superintendencia sobre el IDI.

La AFP debe reportar diariamente a la Superintendencia lo siguiente:

- a) La información que conforma el IDI: Esta información debe ser enviada vía transmisión electrónica a través del sistema SUCAVE, considerando los siguientes Anexos:

- Anexo I: Balance General de la Cartera Administrada.
- Anexo II: Determinación de la variación del número de cuotas de la Cartera Administrada.
- Anexo III: Detalle de los movimientos diarios de los instrumentos u operaciones de inversión en los que se ha invertido los recursos de la Cartera Administrada.
- Anexo IV: Detalle del saldo y de la conciliación de la cuenta Caja y Bancos del Balance General de la Cartera Administrada.
- Anexo V: Detalle de los movimientos diarios de las Cuentas por Cobrar y de las Cuentas por Pagar del Balance General de la Cartera Administrada.
- Anexo VI: Detalle del cobro de derechos y del pago de obligaciones generados por los instrumentos u operaciones de inversión en los que se ha invertido los recursos de la Cartera Administrada.
- Anexo VII: Detalle de las operaciones de compra y venta de monedas realizadas con los recursos de la Cartera Administrada.
- Anexo VIII: Detalle de los instrumentos u operaciones de inversión de la Cartera Administrada mantenidos en guarda física.
- Anexo IX: Detalle de los movimientos diarios de los contratos de derivados.
- Anexo X: Detalle de los movimientos diarios del margen de garantía y colateral de los contratos de derivados.



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

- b) Los códigos de los instrumentos u operaciones de inversión que hayan sido emitidos de manera individual (instrumentos únicos o no seriados): Esta información debe ser enviada en los Anexos que conforman el IDI. En caso de ser necesario, la determinación de los códigos debe ser coordinada con la Superintendencia según la metodología definida en el numeral 2.b) de la presente Circular.
- c) La Superintendencia puede requerir que la AFP, en el plazo y forma prevista para tal efecto, presente la documentación que sustente las inversiones u operaciones realizadas con los recursos de las Carteras Administradas correspondientes a los fondos obligatorios o voluntarios.

6. Horario de presentación del IDI.

La recepción en la Superintendencia del IDI vía transmisión electrónica es hasta las 14:00 horas del día útil siguiente a la fecha del IDI. En caso de presentar errores en la información proporcionada, la AFP debe corregir los errores en el transcurso del día hasta las 17:00 horas.

7. Conformidad de recepción del IDI.

En caso la Superintendencia identifique que la información presentada por la AFP no haya sido remitida conforme a lo previsto en el acápite 5 de la presente Circular, o tal información no sea sustentada cuando se requiera, o corregida dentro de los horarios establecidos en el acápite 6, la AFP no obtiene la conformidad de recepción del IDI de la Cartera Administrada que corresponda al fondo de aportes obligatorios o voluntarios que haya registrado esta situación. La conformidad de recepción del IDI no implica que la Superintendencia de forma posterior y en uso de sus funciones de supervisión pueda determinar el incumplimiento de alguna disposición relativa a la normativa del SPP, e iniciar, de ser el caso, las acciones administrativas correspondientes, siendo absoluta responsabilidad de la AFP cumplir con lo dispuesto en la presente Circular y demás normas aplicables.

Sin perjuicio de lo anterior, la no conformidad de recepción del IDI conlleva a que la AFP tiene la obligación de enviar a la Superintendencia, a más tardar a las 17:00 horas del día útil siguiente a la fecha de presentación del IDI, una carta explicando las causas de la no conformidad de recepción del IDI y las medidas administrativas que va a implementar para evitar la repetición de dicha situación. Esta información debe ser remitida conjuntamente con el IDI del día útil siguiente.

8. Suspensión de la operatividad en inversiones.

La Superintendencia puede determinar la no operatividad parcial o total de las inversiones con los recursos de cualquiera de las Carteras Administradas correspondientes a los fondos de aportes obligatorios o voluntarios en caso que la no conformidad de recepción de un mismo IDI se mantenga por más de dos (02) días consecutivos, así como en los casos en que se detecte irregularidades en el proceso de inversión.

9. Inclusión de indicadores de validación en el envío electrónico del IDI.

La AFP debe incluir en sus sistemas informáticos indicadores de validación que detecten errores de consistencia en la información financiera y contable de las inversiones u operaciones realizadas con los recursos de las Carteras Administradas correspondientes a los fondos obligatorios o voluntarios; ello antes de remitir el IDI a la Superintendencia vía la transmisión electrónica.



SUPERINTENDENCIA
DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

10. Vigencia

La presente circular rige a partir del día siguiente de su publicación en el Diario Oficial El Peruano, a excepción del literal a) del numeral 5 cuya entrada en vigencia se le comunicará a la AFP mediante Oficio Múltiple.

Asimismo, se deja sin efecto la Circular N° AFP 60-2005 a excepción de lo establecido en el literal a) del numeral 3. El citado literal quedará sin efecto en la fecha determinada en el mencionado oficio.

Atentamente,



ANEXO A

**METODOLOGÍA DE CODIFICACIÓN DE INSTRUMENTOS Y OPERACIONES DE INVERSIÓN
INCLUIDOS EN EL INFORME DIARIO DE INVERSIONES**

I. Información requerida para la determinación del código de los intermediarios, los sistemas de negociación electrónica, plazas de negociación, clearer brokers y subyacentes de derivados

Para la codificación de intermediarios y *clearer brokers*, la AFP debe remitir la siguiente información:

- La denominación del intermediario o *clearer broker*, según consta en la documentación oficial.
- El país de constitución del intermediario o *clearer broker*.
- El Organismo supervisor y/o regulador.
- La documentación que sustente lo indicado por la AFP.

Asimismo, para la codificación de sistemas de negociación electrónica y plazas de negociación la AFP debe remitir la siguiente información:

- La denominación del sistema de negociación electrónica o de la plaza de negociación según consta en la documentación oficial.
- El país de constitución de los mismos.
- La documentación relativa a los mismos.

Finalmente, para la codificación de los subyacentes de los derivados la AFP debe remitir la siguiente información:

- La denominación del subyacente del derivado.
- El ISIN, nemónico o ticker de dicho subyacente.

II. Información requerida para la determinación de los códigos de los instrumentos de inversión

1. Información requerida para la codificación del instrumento de inversión

Para la codificación de un instrumento de inversión, la AFP debe remitir a la Superintendencia:

- El código valor del instrumento, de acuerdo a los criterios establecidos en el numeral 1 del Anexo B. En el caso de que un instrumento no presente correspondencia con ninguno de los códigos existentes, debe solicitar a la Superintendencia la creación de un nuevo código valor, adjuntando los valores de cada uno de los criterios incluidos en el mencionado numeral 1 que sean aplicables al instrumento evaluado.
- El código emisor del instrumento, de acuerdo a los criterios establecidos en el numeral 2 del Anexo B. En caso el emisor aún no tenga un código asignado deberá solicitarlo a la Superintendencia, adjuntando adicionalmente la información establecida en el numeral 3



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

del Anexo B.

- El código moneda del instrumento, código correspondiente a la moneda de emisión del mismo. En el caso de que dicha moneda carezca de código, deberá adjuntar una solicitud a la Superintendencia para la asignación de código a dicha moneda. La Superintendencia habilitará para la AFP la lista inicial de códigos de moneda a través del Portal del Supervisado, la cual se irá actualizando a medida que se generen más códigos para los nuevos instrumentos que se negocien con los recursos de las carteras administradas.
- El código referencial del instrumento, según las reglas establecidas en el numeral 8 del Anexo B.
- Las características del instrumento, indicadas en el numeral 9 del Anexo B.
- El prospecto, Offering Memorandum, clasificaciones de riesgo y otra documentación que sustente la información del instrumento brindada a la Superintendencia en los numerales, para propósitos de verificación del código de instrumento remitido por la AFP. De no contarse aún con las versiones finales de los mismos puede remitir las últimas versiones preliminares.

2. Información adicional en caso de ofertas primarias.

En caso que el instrumento corresponda a una oferta primaria, la AFP debe remitir a esta Superintendencia la siguiente información adicional al numeral anterior:

- La descripción de la serie a colocarse, establecida en el numeral 10 del Anexo B.
- El resumen de la colocación, establecido en el numeral 11 del Anexo B.

3. Exclusiones

Se excluyen de la presente metodología los instrumentos emitidos por el BCRP y por el Gobierno Central en el mercado local, los Treasury Bills del Gobierno de Estados Unidos, y los instrumentos derivados, pues estos son incluidos en el vector de precios directamente por la Superintendencia.

PREPUBLICACIÓN

ANEXO B

INFORMACIÓN NECESARIA PARA LA CODIFICACIÓN DE INSTRUMENTOS Y OPERACIONES DE INVERSIÓN INCLUIDOS EN EL INFORME DIARIO DE INVERSIONES

1. Criterios para la asignación del Código Valor.-

Tipo de instrumento	Límite aplicable	Tipo de fondo	Tipo de activo subyacente	Tipo de título de deuda	Aval	Plazo	Tipo de emisor	Nacionalidad	Subtipo de instrumento	Código	Descripción del tipo de instrumento
Certificado de depósito	Local						Empresa Financiera		CD de corto plazo no negociable	61	CERTIFICADO DEPOSITO CP
Certificado de depósito	Local						Empresa Financiera		CD individual	62	CD INDIVIDUALES SUBASTADO AFP
Certificado de depósito	Local						Empresa Financiera		CD negociable seriado	63	CD SERIADOS SUBASTADO BCOS
Certificado de depósito	Local						Empresa Financiera		CD estructurado	68	CERTIFICADO DE DEPOSITO ESTRUCTURADO
Certificado de depósito	Extranjero									67	CERTIFICADOS DE DEPOSITO A PLAZO EXTRANJERO



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

Tipo de instrumento	Límite aplicable	Tipo de fondo	Tipo de activo subyacente	Tipo de título de deuda	Aval	Plazo	Tipo de emisor	Nacionalidad	Subtipo de instrumento	Código	Descripción del tipo de instrumento
Depósito bancario	Extranjero								Depósito overnight CMS	6B	DEPÓSITOS OVERNIGHT - CMS
Fondo mutuo	Local	Fondo mutuo alternativo						Extranjero bajo límite local		48	Fondo Mutuo Alternativo Extranj- Límite Local
Fondo mutuo	Local	Fondo de inversión tradicional						Local		49	FONDO DE INVERSION TRADICIONAL
Fondo mutuo	Local	Fondo mutuo tradicional						Local		50	FONDO MUTUO
Fondo mutuo	Local	Fondo de inversión alternativo						Local		51	FONDO DE INVERSION ALTERNATIVO
Fondo mutuo	Local	ETF								54	FONDOS MUTUOS DEL EXT - ETF DEL MERCADO LOCAL
Fondo mutuo	Extranjero	Fondo mutuo tradicional								52	FONDOS MUTUOS DEL EXTRANJERO



SUPERINTENDENCIA
DE BANCA, SEGUROS Y AFP
República del Perú

PREPUBLICACIÓN

Tipo de instrumento	Límite aplicable	Tipo de fondo	Tipo de activo subyacente	Tipo de título de deuda	Aval	Plazo	Tipo de emisor	Nacionalidad	Subtipo de instrumento	Código	Descripción del tipo de instrumento
Fondo mutuo	Extranjero	Fondo mutuo alternativo								53	Fondo Mutuo Alternativo Extranjero
Operaciones de reporte	Local		Acciones de capital							80	OPERACION DE REPORTE CON ACCIONES DEL CAPITAL
Operaciones de reporte	Local		Acciones de trabajo							81	OPERACION DE REPORTE CON ACCIONES DEL TRABAJO
Operaciones de reporte	Local		Bonos							82	OPERACION DE REPORTE CON BONOS
Título de capital	Local								Acción común	30	ACCIONES DEL CAPITAL SOCIAL
Título de capital	Local								Acción de inversión	31	ACCIONES DEL TRABAJO
Título de capital	Local								ADR	32	VALOR REP.DERECHO SOBRE ACC. EMP.NAC.



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

Tipo de instrumento	Límite aplicable	Tipo de fondo	Tipo de activo subyacente	Tipo de título de deuda	Aval	Plazo	Tipo de emisor	Nacionalidad	Subtipo de instrumento	Código	Descripción del tipo de instrumento
Título de capital	Local								Acción común no listada en bolsa	35	ACCIONES DE CAPITAL SOCIAL NO LISTADAS BOLSA
Título de capital	Local								Acción común por privatización	36	ACCIONES DE CAPITAL POR PRIVATIZACION
Título de capital	Local								Certificado de participación	37	TITULOS CON DERECHO DE PARTICIPACION
Título de capital	Local								Acción para nuevos proyectos	38	ACCIONES PARA NUEVOS PROYECTOS
Título de capital	Local								Certificado de suscripción preferente	40	CERTIFICADOS DE SUSCRIPCION PREFERENTE
Título de capital	Local								Acción preferente	41	ACCIONES PREFERENTES DE EMPRESAS (RF)



SUPERINTENDENCIA
DE BANCA, SEGUROS Y AFP
República del Perú

PREPUBLICACIÓN

Tipo de instrumento	Límite aplicable	Tipo de fondo	Tipo de activo subyacente	Tipo de título de deuda	Aval	Plazo	Tipo de emisor	Nacionalidad	Subtipo de instrumento	Código	Descripción del tipo de instrumento
Título de capital	Local								Constancia de suscripción de acciones	44	CONSTANCIAS DE SUSCRIPCIÓN DE ACCIONES
Título de capital	Extranjero								ADS	33	VALOR REP.DERECHO SOBRE ACC. EMP.EXT.
Título de capital	Extranjero								Acción común	34	ACCIONES EN EL EXTRANJERO
Título de capital	Extranjero								Acción preferente	42	ACCION PREFERENTE DE EMP EXT
Título de capital	Extranjero								Acción preferencial	45	ACCION PREFERENCIAL DE EMP EXTERIOR
Título de capital	Extranjero								Certificado de participación	58	TITULOS CON DERECHO DE PARTICIPACIÓN DEL EXTR
Título de capital	Extranjero								Unit Share	46	UNIT SHARES DEL EXTERIOR



SUPERINTENDENCIA
DE BANCA, SEGUROS Y AFP
República del Perú

PREPUBLICACIÓN

Tipo de instrumento	Límite aplicable	Tipo de fondo	Tipo de activo subyacente	Tipo de título de deuda	Aval	Plazo	Tipo de emisor	Nacionalidad	Subtipo de instrumento	Código	Descripción del tipo de instrumento
Título de deuda	Local			Certificado Único de Compensación Tributaria						02	CERTIFICADOS UNICOS COMPENSACION TRIBUTARIS
Título de deuda	Local			Bono			Empresa Financiera	Extranjero bajo límite local		16	TIT. DEUDA ENTIDADES FIN.EXT. - EMI. LOCAL
Título de deuda	Local			Bono			Empresa No Financiera	Extranjero bajo límite local		17	TIT.DEUDA ENTIDADES NO FIN. EXT.- EMI.LOCAL
Título de deuda	Local			Bono			Empresa No Financiera	Local	Bono para nuevos proyectos	18	BONO PARA NUEVOS PROYECTOS
Título de deuda	Local			Bono			Empresa Financiera	Local	Bono de Arrendamiento Financiero	20	BONOS DE ARRENDAMIENTO SISTEMA FINANCIERO
Título de deuda	Local			Bono			Empresa Financiera	Local	Bono Subordinado	21	BONOS SUBORDINADOS SISTEMA FINANCIERO



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

Tipo de instrumento	Límite aplicable	Tipo de fondo	Tipo de activo subyacente	Tipo de título de deuda	Aval	Plazo	Tipo de emisor	Nacionalidad	Subtipo de instrumento	Código	Descripción del tipo de instrumento
Título de deuda	Local			Bono			Empresa No Financiera	Local	Bono corporativo	22	BONOS DE EMPRESAS PRIVADAS
Título de deuda	Local			Papel Comercial						23	PAPELES COMERCIALES
Título de deuda	Local			Bono estructurado					Bono estructurado	24	BONOS ESTRUCTURADOS
Título de deuda	Local			Bono			Empresa Financiera	Local	Otros Bonos del Sistema Financiero	25	OTROS BONOS SISTEMA FINANCIERO
Título de deuda	Local			Bono			Fondo de inversión			26	BONOS DE FONDOS DE INVERSION
Título de deuda	Local			Bono titulizado					Bono titulizado no hipotecario	27	TITULOS CON DERECHO CREDITICIO
Título de deuda	Local			Bono			Empresa Financiera	Local	Bono Hipotecario	28	BONOS HIPOTECARIOS DEL SECTOR FINANCIERO



SUPERINTENDENCIA
DE BANCA, SEGUROS Y AFP
República del Perú

PREPUBLICACIÓN

Tipo de instrumento	Límite aplicable	Tipo de fondo	Tipo de activo subyacente	Tipo de título de deuda	Aval	Plazo	Tipo de emisor	Nacionalidad	Subtipo de instrumento	Código	Descripción del tipo de instrumento
Título de deuda	Local			Bono			Organismo multilateral			29	TIT. DEUDA EMITIDOS ORG INT - LOCAL
Título de deuda	Local			GDN			Estado			43	VAL REP DER CRED SOBRE DEUDA GOB CEN-GDN
Título de deuda	Local			Bono titulizado					Bono titulizado hipotecario	47	BONOS TITULIZADOS HIPOTECARIOS
Título de deuda	Local			Pagaré	Avalado		Empresa Financiera			70	PAGARES AVALADOS POR EMPRESAS FINANCIERAS
Título de deuda	Local			Letra					Letras hipotecarias	71	LETRAS HIPOTECARIAS
Título de deuda	Local			Pagaré	Avalado		Empresa No Financiera			72	PAGARES AVALADOS POR EMPRESAS NO FINANCIERAS
Título de deuda	Local			Pagaré	No avalado	Corto plazo				73	PAGARES NO AVALADOS



SUPERINTENDENCIA
DE BANCA, SEGUROS Y AFP
República del Perú

PREPUBLICACIÓN

Tipo de instrumento	Límite aplicable	Tipo de fondo	Tipo de activo subyacente	Tipo de título de deuda	Aval	Plazo	Tipo de emisor	Nacionalidad	Subtipo de instrumento	Código	Descripción del tipo de instrumento
Título de deuda	Local			Letra					Letras comerciales	75	LETRAS COMERCIALES
Título de deuda	Local			Pagaré	No avalado	Largo plazo				76	PAGARES NO AVALADOS DE LARGO PLAZO
Título de deuda	Local			Bono estructurado					Bono engrapado	83	BONO ESTRUCTURADO ENGRAPADO
Título de deuda	Extranjero			Bono			Agencia del gobierno			07	TIT. DEUDA EMITIDOS POR AGENCIAS DEL EXTRANJ.
Título de deuda	Extranjero			Bono			Estado			08	TIT. DEUDA EMITIDOS POR ESTADOS DEL EXTRANJER
Título de deuda	Extranjero			Bono			Organismo multilateral			09	TIT. DEUDA EMITIDOS POR ORGANISMOS INTERNACIO



SUPERINTENDENCIA
DE BANCA, SEGUROS Y AFP
República del Perú

PREPUBLICACIÓN

Tipo de instrumento	Límite aplicable	Tipo de fondo	Tipo de activo subyacente	Tipo de título de deuda	Aval	Plazo	Tipo de emisor	Nacionalidad	Subtipo de instrumento	Código	Descripción del tipo de instrumento
Título de deuda	Extranjero			Bono			Empresa No Financiera		Bono	12	BONOS DE EMPRESA PRIVADA EXTRANJERA
Título de deuda	Extranjero			Bono			Empresa No Financiera		GDN	14	VAL REP DER CRED SOBRE DEUDA EMP EXT - GDN
Título de deuda	Extranjero			Bono			Empresa Financiera			15	BONO SISTEMA FINANCIERO EXTRANJERO
Título de deuda	Extranjero			Bono			Banco Central			19	TIT. DEUDA EMITIDOS POR BCOS CENTRALES EXTRAN
Título de deuda	Extranjero			Bono titulizado						57	TITULOS CON DERECHO CREDITICIO DEL EXTERIOR



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

Tipo de instrumento	Límite aplicable	Tipo de fondo	Tipo de activo subyacente	Tipo de título de deuda	Aval	Plazo	Tipo de emisor	Nacionalidad	Subtipo de instrumento	Código	Descripción del tipo de instrumento
Título de deuda	Extranjero			Bono			Empresa pública			59	TIT. DEUDA EMITIDOS EMPRESAS PÚBLICAS EXTRAN



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

2. Código de Emisor: El código de emisor se asigna de la siguiente manera:

- En el caso de que el instrumento sea un fondo mutuo (códigos valores 48, 49, 50, 51, 52, 53 y 54), se asigna el código de emisor a la sociedad administradora/gestora del mismo.
- En el caso de instrumentos titulizados (códigos valores 27, 37, 47, 57 y 58), el código se asigna según la siguiente tabla:

Tipo de instrumento	País de constitución del patrimonio en fideicomiso	Código de emisor
Bono titulizado	Perú	Sociedad titulizadora
	Otro país	Vehículo de propósito especial (SPV)
Certificado de participación		Patrimonio en fideicomiso/Titulizado

- Para todos los demás casos, se procede de acuerdo a la siguiente tabla:

Entidad emisora	Código de emisor
Empresa	La misma empresa
Vehículo de propósito especial	La empresa garante de los flujos del instrumento

3. Información necesaria para la creación de un nuevo código emisor

Campo	Descripción
Nombre de Emisor	Indicar Nombre de Emisor
Sector del Emisor	Indicar el Sector del Emisor (ver numeral 4)
Tipo de Emisor	Indicar el Tipo de Emisor (ver numeral 5)
Grupo Económico	Indicar el Grupo Económico
Sector Económico	Indicar el Sector Económico (ver numeral 6)
Actividad Económica	Indicar la actividad y sub-actividad económica (ver numeral 7)
Origen	Indicar la nacionalidad del instrumento para límites: 1. Nacional (incluye los instrumentos extranjeros bajo límite local) 2. Extranjero
País Origen	Indicar el país del emisor.

4. Sector del emisor

Nº	Sector del emisor
1	Gobierno
2	Sistema Financiero
3	Sistema No Financiero



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

N°	Sector del emisor
4	Administradoras de fondos
5	Sociedades Titulizadoras

5. Tipo de emisor

N°	Sector del emisor
1	Gobierno
2	Bancos
3	Financieras
4	Arrendamiento Financiero
5	Empresa Crédito de Consumo
6	Otras empresas del Sector Financiero
7	Instituciones de Inversión
8	Industriales, servicios
9	Organismos Internacionales
10	Sociedades Titulizadoras
11	Otros

6. Sector económico

N°	Sector del emisor
1	Gobierno
2	Bancos
3	Financieras
4	Arrendamiento Financiero
5	Sociedades Titulizadoras
6	Otras Empresas Financieras
7	Fondos de Inversión
8	Petróleo y Productos Químicos
9	Alimentos
10	Bebidas
11	Cementos
12	Productos Minerales no Metálicos
13	Maquinaria y Equipo
14	Metálicas Básicas
15	Otras Industrias
16	Inmobiliaria y Construcción
17	Mineras
18	Pesqueras



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

N°	Sector del emisor
19	Servicios Públicos
20	Energía
21	Telecomunicaciones
22	Diversas

7. Actividad y sub-actividad económica

Nro	Actividad económica	Sub-Actividad económica
1	Gobierno	
2	Bancos	
3	Financieras	
4	Compañías de Seguros	
5	Arrendamiento Financiero	
6	Sociedades Titulizadoras	
7	Organismos Multilaterales	
8	Entidades Financieras Internacionales*	
9	Otras Empresas Financieras	
10	Industria	Alimentos
		Bebidas
		Cemento
		Maquinaria
		Metálicas Básicas
		Otras
11	Almacenes Comerciales	
12	Hidrocarburos	
13	Inmobiliaria y Construcción	
14	Minería	
15	Pesca	
16	Servicios Públicos	Energía
		Telecomunicaciones
		Otros
17	Sociedades Concesionarias	
18	Otros	

8. Código Referencial

Su representada debe remitir el código referencial del instrumento, el cual está considerado en el formato antes mencionado, de acuerdo a las siguientes reglas:

a) **Títulos de deuda extranjeros (códigos valores 07, 08, 09, 12, 14, 15, 16, 17, 19, 57, 59).-**



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

Los cinco (5) últimos dígitos del ISIN del instrumento.

- b) **Títulos de deuda locales emitidos por empresas financieras y no financieras (códigos valores 18, 20, 21, 22, 23, 24, 25, 28, 29, 63, 76).**-

En caso que la emisión del instrumento se realice en el Perú, el código referencial se construirá de la siguiente manera:

- Dos primeros caracteres: Los dos últimos dígitos del año de emisión.
- Dos siguientes caracteres: Número de emisión.
- Último carácter: Serie, y en caso sea una serie única se debe poner la letra "u".

En caso la emisión del instrumento se realice en el exterior, el código referencial corresponderá a los cinco (5) últimos dígitos del ISIN del instrumento.

- c) **Acciones locales (códigos valores 30, 31, 40).**- Correlativo por cada emisor (por ejemplo 00001).

- d) **Acciones del exterior, ADR y ADS (códigos valores 32, 33, 34, 45, 46).**- Los cinco (5) últimos dígitos del ISIN del instrumento.

- e) **Fondos mutuos tradicionales extranjeros (códigos valores 52, 54).**- De la siguiente manera:

- Primer carácter: Carácter "E" (si es un ETF) o "F" (si no es un ETF).
- Cuatro siguientes caracteres: Cinco (5) últimos dígitos del ISIN menos el último carácter (por ejemplo: el ETF "US81369Y1001" tendría como referencial a "EY100")

- f) **GDN del Gobierno Central (código valor 43).**- De la siguiente manera:

- Dos primeros caracteres: El día del vencimiento.
- Tercer carácter: El mes de vencimiento según la siguiente tabla:

Mes	Caracter
Enero	E
Febrero	F
Marzo	M
Abril	A
Mayo	Y
Junio	J
Julio	L
Agosto	G
Septiembre	S
Octubre	O
Noviembre	N
Diciembre	D

- Dos últimos caracteres: Los dos últimos dígitos del año de vencimiento

Por ejemplo, si la fecha de vencimiento del instrumento es 12/08/2031, el referencial correspondiente sería 12G31.

- g) **Titulizados locales y extranjeros, fondos de inversión tradicionales locales, fondos alternativos locales, extranjeros y extranjeros bajo límite local (códigos valores 27, 37, 47, 48, 49, 51, 53, 54).** Es definido por la Superintendencia.



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

9. Características del Instrumento (*).-

N°	Campo	Descripción
1	Denominación del Instrumento	Colocar la denominación del instrumento de acuerdo a lo indicado en su prospecto.
2	Nombre de Emisor	Indicar Nombre de Emisor correspondiente al código asignado según lo establecido en el punto 2.
3	País del emisor	País de residencia del emisor.
4	Moneda	Indicar la Moneda de Emisión.
5	Categoría del Instrumento	Indicar la Categoría del Instrumento: 1. Activos en Efectivo. 2. Renta Fija. 3. Renta Variable. 4. Instrumentos Alternativos
6	Límite aplicable	Límite por nacionalidad aplicable al instrumento: 1. Local. 2. Extranjero. 3. Extranjero bajo límite local.
7	Número de Programa y Emisión	Indicar Número de Programa y Emisión
8	Clasificación de riesgo equivalente	Clasificación de riesgo equivalente dado al instrumento.
9	Tasa de encaje	Tasa de encaje correspondiente a la clasificación de riesgo equivalente.
10	País de emisión del instrumento	Indicar el país de emisión del instrumento
11	Sociedad titulizadora/administradora	Para el caso de patrimonios titulizados/ fondos mutuos, indicar el nombre de la sociedad titulizadora /administradora
12	Patrimonio Fideicometido/Fondo mutuo	Para el caso de patrimonios titulizados/ fondos mutuos, indicar el nombre del patrimonio titulado/fondo mutuo.
13	País de constitución del patrimonio/fondo mutuo	Indicar el país de constitución del patrimonio/fondo mutuo
14	Vehículo de propósito especial	En caso el instrumento sea emitido por un vehículo de propósito especial (SPV) indicar el nombre del vehículo.
15	País de constitución del vehículo	Indicar el país de constitución del vehículo
16	Estrategia del fondo alternativo	En caso el instrumento sea un fondo alternativo, indicar la estrategia del fondo mutuo: 1. Private equity 2. Real State 3. Infraestructura En caso sea un fondo tradicional, indicar "Tradicional".

**SUPERINTENDENCIA**

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

N°	Campo	Descripción
17	Libre elegibilidad	Indicar si el instrumento se encuentra o no bajo el límite de libre elegibilidad del fondo.
18	Observaciones y comentarios	Indicar observaciones y comentarios adicionales al instrumento.
19	Nombre - contacto	Nombre de la persona a quien se puede solicitar información adicional sobre el instrumento. Aplicable únicamente a ofertas privadas.
20	Correo electrónico - contacto	Correo electrónico de la persona a quien se puede solicitar información adicional sobre el instrumento. Aplicable únicamente a ofertas privadas.

(*) En caso algún campo no sea aplicable dada la naturaleza del instrumento, colocar "No aplica"

10. Descripción de la Series a Colocarse (*) ().-**

N°	Campo	Descripción
1	Nombre de la Serie	Indicar Nombre de la Serie
2	Clasificación de Riesgo 1	Indicar la primera Clasificación de Riesgo dada por la empresa clasificadora.
3	Clasificadora de Riesgo 1	Indicar la empresa clasificadora que otorgó la primera Clasificación de Riesgo.
4	Clasificación de Riesgo 2	Indicar la segunda Clasificación de Riesgo dada por la empresa clasificadora.
5	Clasificadora de Riesgo 2	Indicar la empresa clasificadora que otorgó la segunda Clasificación de Riesgo.
6	Moneda de la Emisión	Indicar la Moneda de la Emisión
7	Moneda del Pago del Principal	Indicar la Moneda del Pago del Principal
8	Moneda del Pago de Intereses	Indicar la Moneda del Pago de Intereses
9	Monto	Indicar el Monto de la Serie
10	Valor Nominal	Indicar el Valor Nominal de cada instrumento de la emisión
11	Número de Instrumentos a Emitirse	Indicar el Número de Instrumentos a Emitirse
12	Plazo	Indicar el Plazo
13	Fecha de Colocación	Indicar la Fecha de Colocación
14	Monto Máximo Autorizado de la Colocación	Indicar el Monto Máximo Autorizado de Colocación
15	Destino de Fondos Captado	Indicar el destino de los Fondos Captados.
16	Tipo de oferta	Indicar si la oferta es: 1. Pública 2. Privada
17	País de la colocación	Indicar el país de la colocación
18	Nombre del Procedimiento de Mecanismo no Centralizado de Negociación de Valores Mobiliarios	Indicar el nombre del Procedimiento de Mecanismo no Centralizado de Negociación



SUPERINTENDENCIA

DE BANCA, SEGUROS Y AFP

República del Perú

PREPUBLICACIÓN

N°	Campo	Descripción
19	Nombre de Institución Colocadora	Indicar el nombre de la Institución Colocadora
20	Institución responsable de la Administración del Mecanismo no Centralizado de Negociación de Valores Mobiliarios	Indicar el nombre de la Institución responsable de la Administración del Mecanismo no Centralizado de Negociación

(*) Remitir en caso se trate de una oferta primaria en la cual se haya adjudicado participación a la AFP.

(**) En caso algún campo no sea aplicable dada la naturaleza del instrumento, colocar "No aplica"

11. Resumen de la Colocación – Oferta Primaria (*) (**).-

N°	Campo	Descripción
1	Código del Instrumento	Indicar el código del Instrumento
2	Monto Total Colocado del Instrumento	Indicar el monto total colocado del Instrumento
3	Fondo 0	Indicar el monto adquirido/comprometido por el Fondo 0 de la AFP
4	Fondo 1	Indicar el monto adquirido/comprometido por el Fondo 1 de la AFP
5	Fondo 2	Indicar el monto adquirido/comprometido por el Fondo 2 de la AFP
6	Fondo 3	Indicar el monto adquirido/comprometido por el Fondo 3 de la AFP
7	Tasa de colocación	Tasa de colocación del instrumento.

(*) Remitir en caso se trate de una oferta primaria en la cual se haya adjudicado participación a la AFP.

(**) En caso algún campo no sea aplicable dada la naturaleza del instrumento, colocar "No aplica"

INFORME DIARIO DE INVERSIONES

ANEXO N° I

NOMBRE DE LA AFP: _____
NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA: _____
FECHA: _____

1. BALANCE GENERAL DE LA CARTERA ADMINISTRADA.

1.1 DETERMINACION DEL VALOR DE LA CUOTA	# CUOTAS	MONTO S/.
1.1.1 VALOR DE LA CARTERA ADMINISTRADA		
1.1.2 NUMERO DE CUOTAS EMITIDAS		
1.1.2.1 VARIACION DEL NUMERO DE CUOTAS		
1.1.2.1.1 CUOTAS DE CIC		
1.1.2.1.2 CUOTAS DE ENCAJE MANTENIDO		
1.1.2.2 SALDO ANTERIOR DE CUOTAS		
1.1.3 VALOR DE LA CUOTA		
1.2 DETERMINACION DEL VALOR DE LA CARTERA ADMINISTRADA	MONTO EN S/.	MONTO EN S/.
1.2.1 ACTIVOS		
TOTAL DE ACTIVOS		
1.2.1.1 CAJA Y BANCOS		
1.2.1.2 CUENTAS POR COBRAR		
1.2.1.3 INVERSIONES		
1.2.1.3.1 VALORES EMITIDOS POR EL ESTADO PERUANO SIN INCLUIR EL BCRP		
1.2.1.3.2 VALORES EMITIDOS O GARANTIZADOS POR EL BCRP		
1.2.1.3.3 VALORES EMITIDOS POR INSTITUCIONES PERTENECIENTES AL SECTOR PUBLICO DIFERENTES DEL BCRP		
1.2.1.3.4 VALORES EMITIDOS POR INSTITUCIONES PERTENECIENTES AL SECTOR PÚBLICO DIFERENTES DEL BCRP		
1.2.1.3.5 DEPOSITOS A PLAZO Y OTROS TITULOS REPRESENTATIVOS DE CAPTACIONES POR PARTE DE EMPRESAS DEL SISTEMA FINANCIERO		
1.2.1.3.6 BONOS EMITIDOS POR PERSONAS JURIDICAS PERTENECIENTES O NO AL SISTEMA FINANCIERO		
1.2.1.3.7 INSTRUMENTOS DE INVERSION EMITIDOS PARA EL FINANCIAMIENTO HIPOTECARIO POR EMPRESAS BANCARIAS O FINANCIERAS, Y SUS SUBSIDIARIAS		
1.2.1.3.8 INSTRUMENTOS DE INVERSION EMITIDOS PARA EL FINANCIAMIENTO HIPOTECARIO POR OTRAS ENTIDADES CON O SIN GARANTIA DEL FONDO MIVIVIENDA U OTRAS INSTITUCIONES		
1.2.1.3.9 OTROS INSTRUMENTOS DE CORTO PLAZO DISTINTOS A LOS DE CAPTACION POR PARTE DE LAS EMPRESAS DEL SISTEMA FINANCIERO		
1.2.1.3.10 OPERACIONES DE REPORTE		
1.2.1.3.11 ACCIONES Y VALORES REPRESENTATIVOS DE DERECHOS SOBRE ACCIONES EN DEPOSITO INSCRITOS EN UNA BOLSA DE VALORES		
1.2.1.3.12 CERTIFICADOS DE SUSCRIPCION PREFERENTE		
1.2.1.3.13 PRODUCTOS DERIVADOS DE VALORES QUE SE NEGOCIEEN EN MECANISMO CENTRADO DE NEGOCIACION		
1.2.1.3.14 OPERACIONES DE COBERTURA DE LOS RIESGOS FINANCIEROS		
1.2.1.3.15 CUOTAS DE PARTICIPACION DE LOS FONDOS MUTUOS DE INVERSION EN VALORES Y DE LOS FONDOS DE INVERSION		
1.2.1.3.16 INSTRUMENTOS DE INVERSION REPRESENTATIVOS DE ACTIVOS TITULIZADOS		
1.2.1.3.17 INSTRUMENTOS FINANCIEROS EMITIDOS O GARANTIZADOS POR ESTADOS Y BANCOS CENTRALES DE PAISES EXTRANJEROS, ASI COMO ACCIONES Y VALORES REPRESENTATIVOS DE DERECHOS SOBRE ACCIONES EN DEPOSITO INSCRITOS EN BOLSAS DE VALORES, INSTRUMENTOS DE DEUDA, CUOTAS DE PARTICIPACION DE FONDOS MUTUOS Y OPERACIONES DE COBERTURA DE RIESGO EMITIDAS POR INSTITUCIONES EXTRANJERAS		
1.2.1.3.18 EMISIONES PRIMARIAS DE ACCIONES Y/O VALORES MOBILIARIOS REPRESENTATIVOS DE DERECHOS CREDITICIOS DIRIGIDOS A FINANCIAR EL DESARROLLO DE NUEVOS PROYECTOS		
1.2.1.3.19 PAGARES EMITIDOS O AVALADOS POR EMPRESAS DEL SISTEMA FINANCIERO		
1.2.1.3.20 PAGARES EMITIDOS Y AVALADOS POR OTRAS ENTIDADES		
1.2.1.3.21 INSTRUMENTOS FINANCIEROS DESTINADOS AL DESARROLLO DE PROYECTOS DE INFRAESTRUCTURA, CONCESIONES, VIVIENDA, EXPLOTACION DE RECURSOS NATURALES Y BOSQUES CULTIVADOS U OTROS SECTORES QUE POR SUS CARACTERISTICAS REQUIERAN FINANCIAMIENTO DE MEDIANO Y LARGO PLAZO		
1.2.1.3.22 DIFERENCIAL DE INSTRUMENTOS DERIVADOS PARA COBERTURA		
1.2.1.3.23 OTROS INSTRUMENTOS U OPERACIONES QUE AUTORICE LA SBS		
1.2.2 PASIVOS		
TOTAL PASIVOS		
TOTAL PASIVO EXIGIBLE		
1.2.2.1 CUENTAS POR PAGAR		
1.2.2.1.1 CUENTAS POR PAGAR PROVENIENTES DE LAS TRANSACCIONES CON INSTRUMENTOS U OPERACIONES DE INVERSION		
1.2.2.1.2 CUENTAS POR PAGAR PROVENIENTES DEL PAGO DE BENEFICIOS		
1.2.2.1.3 OTRAS CUENTAS POR PAGAR		
1.2.2.2 DIFERENCIAL DE INSTRUMENTOS DERIVADOS PARA COBERTURA		
TOTAL ENCAJE		
1.2.2.3 ENCAJE REQUERIDO		
1.2.2.4 SUPERAVIT (DEFICIT) ENCAJE LEGAL		
1.2.2.5 ENCAJE MANTENIDO		
1.2.3 PATRIMONIO DEL FONDO DE PENSIONES		
TOTAL PATRIMONIO DEL FONDO DE PENSIONES		
1.2.3.1 CUENTAS INDIVIDUALES DE CAPITALIZACION		
1.2.3.1.1 APORTES OBLIGATORIOS DE LOS TRABAJADORES		
1.2.3.1.2 APORTES VOLUNTARIOS DE LOS TRABAJADORES		
1.2.3.1.2.1 APORTES VOLUNTARIOS CON FIN PREVISIONAL		
1.2.3.1.2.2 APORTES VOLUNTARIOS SIN FIN PREVISIONAL		
1.2.3.1.3 APORTES CLASIFICADOS		
1.2.3.1.4 APORTES POR CLASIFICAR		
1.2.3.1.4.1 RECAUDACION POR CLASIFICAR		
1.2.3.1.4.2 PAGOS EN EXCESO ACUMULADOS		
1.2.3.1.4.3 REZAGOS		
1.2.3.1.4.4 OTROS APORTES POR CLASIFICAR		
1.3 CUENTAS DE ORDEN		
1.3.1 CUENTAS DE ORDEN DEUDORAS		
1.3.1.1 CONTRATOS DE FUTUROS		
1.3.1.2 CONTRATOS DE OPCIONES		
1.3.1.3 CONTRATOS DE FORWARDS		
1.3.1.4 CONTRATOS DE SWAPS		
1.3.1.5 CONTRATOS DE CREDIT DEFAULT SWAPS		
1.3.1.6 OTROS		
1.3.2 CUENTAS DE ORDEN ACREEDORAS		
1.3.2.1 CONTRATOS DE FUTUROS		
1.3.2.2 CONTRATOS DE OPCIONES		
1.3.2.3 CONTRATOS DE FORWARDS		
1.3.2.4 CONTRATOS DE SWAPS		
1.3.2.5 CONTRATOS DE CREDIT DEFAULT SWAPS		
1.3.2.6 OTROS		

ANEXO N° II

2. DETERMINACION DE LA VARIACION DEL NUMERO DE CUOTAS DE LA CARTERA ADMINISTRADA.

	# CUOTAS	MONTO EN S/.	EFFECTIVO MONEDA 1/	PROVISIÓN MONEDA 2/	VALOR CUOTA 3/
2.1 AUMENTO DEL NUMERO DE CUOTAS					
2.1.1 APORTACIONES					
2.1.2 TRASPASOS RECIBIDOS DESDE OTROS FONDOS					
2.1.3 BONOS DE RECONOCIMIENTO REDIMIDOS O TRANSFERIDOS					
2.1.4 OTROS PAGOS RECIBIDOS DESDE OTROS FONDOS					
2.1.4.1 REZAGOS TRANSFERIDOS					
2.1.4.2 TRANSFERENCIA POR MULTIAFILIACION					
2.1.5 EXCEDENTE DEL FONDO COMPLEMENTARIO SOBRE LOS SINIESTROS ESTIMADOS					
2.1.6 ENCAJE MANTENIDO					
2.1.7 INTERESES MORATORIOS					
2.1.7.0.0.1 SOLES					
2.1.7.0.0.2 DOLARES					
2.1.7.0.0.4 EUROS					
2.1.7.0.0.5 LIBRAS					
2.1.7.0.0.6 YENES					
2.1.8 APORTES CIC - INVALIDEZ					
2.1.9 REGULARIZACION DE RECAUDACION					
2.1.10 REGULARIZACION DE BENEFICIOS					
2.1.11 APORTE ADICIONAL RECIBIDO DE EMPRESA DE SEGUROS-INVALIDEZ					
2.1.12 APORTE ADICIONAL RECIBIDO DE EMPRESA DE SEGUROS-SOBREVIVENCIA					
2.1.13 TRANSFERENCIAS DE FONDOS RECIBIDOS DEL EXTERIOR					
2.1.13.0.0.1 SOLES					
2.1.13.0.0.2 DOLARES					
2.1.13.0.0.4 EUROS					
2.1.13.0.0.5 LIBRAS					
2.1.13.0.0.6 YENES					
2.1.14 OTRAS REGULARIZACIONES Y OPERACIONES					
2.2 DISMINUCION DEL NUMERO DE CUOTAS					
2.2.1 TRASPASOS ENVIADOS HACIA OTROS FONDOS					
2.2.2 BENEFICIOS					
2.2.2.1 JUBILACION					
2.2.2.1.1 RETIRO PROGRAMADO					
2.2.2.1.2 RENTA VITALICIA FAMILIAR					
2.2.2.1.3 RENTA TEMPORAL CON RENTA VITALICIA DIFERIDA					
2.2.2.2 INVALIDEZ					
2.2.2.2.1 RETIRO PROGRAMADO					
2.2.2.2.2 RENTA VITALICIA FAMILIAR					
2.2.2.2.3 RENTA TEMPORAL CON RENTA VITALICIA DIFERIDA					
2.2.2.3 SOBREVIVENCIA					
2.2.2.3.1 RETIRO PROGRAMADO					
2.2.2.3.2 RENTA VITALICIA FAMILIAR					
2.2.2.3.3 RENTA TEMPORAL CON RENTA VITALICIA DIFERIDA					
2.2.2.4 JUBILACION ANTICIPADA					
2.2.2.4.1 RETIRO PROGRAMADO					
2.2.2.4.2 RENTA VITALICIA FAMILIAR					
2.2.2.4.3 RENTA TEMPORAL CON RENTA VITALICIA DIFERIDA					
2.2.2.5 JUBILACION ANTICIPADA-REGIMEN EXTRAORDINARIO					
2.2.2.6 JUBILACION ANTICIPADA-REGIMEN GENERICO					
2.2.2.6.1 RETIRO PROGRAMADO					
2.2.2.6.2 RENTA VITALICIA FAMILIAR					
2.2.2.6.3 RENTA TEMPORAL CON RENTA VITALICIA DIFERIDA					
2.2.2.7 REGIMEN ESPECIAL DE JUBILACION ANTICIPADA PARA DESEMPLEADOS					
2.2.2.7.1 RETIRO PROGRAMADO					
2.2.2.7.2 RENTA VITALICIA FAMILIAR					
2.2.2.7.3 RENTA TEMPORAL CON RENTA VITALICIA DIFERIDA					
2.2.2.8 JUBILACION ADELANTADA DEL DECRETO LEY N° 19990					
2.2.2.9 JUBILACION PENSION MINIMA					
2.2.3 DEVOLUCION POR PAGOS EN EXCESO DE EMPLEADORES Y AFILIADOS					
2.2.4 RETIROS DE AHORRO VOLUNTARIO					
2.2.5 ENCAJE MANTENIDO					
2.2.6 EXTORNOS DE RECAUDACION					
2.2.7 REZAGOS					
2.2.8 NULIDAD DE CONTRATO					
2.2.9 MULTIAFILIACION					
2.2.10 GASTOS DE SEPELIO					
2.2.11 RETIRO HEREDITARIO					
2.2.12 EXCEDENTE DE PENSION					
2.2.13 DEVOLUCION APORTES DEL SPP					
2.2.14 TRANSFERENCIAS DE FONDOS ENVIADAS AL EXTERIOR					
2.2.14.0.0.1 SOLES					
2.2.14.0.0.2 DOLARES					
2.2.14.0.0.4 EUROS					
2.2.14.0.0.5 LIBRAS					
2.2.14.0.0.6 YENES					
2.2.15 DEVOLUCION DE APORTES CTS					
2.2.16 DEVOLUCION DE APORTES OTROS REGIMENES					
2.2.17 BONO DE RECONOCIMIENTO TRANSFERIDO A LA ONP POR NULIDAD					
2.2.18 RECUPERO DE APORTES Y/O BONO DE RECONOCIMIENTO					
2.2.18.1 JUBILACION					
2.2.18.2 INVALIDEZ					
2.2.18.3 SOBREVIVENCIA					
2.2.19 TRANSFERENCIA DE APORTES RECUPERADOS DE AFILIADOS CON GARANTIA ESTATAL					
2.2.20 OTRAS REGULARIZACIONES DE BENEFICIOS					
2.2.21 OTRAS REGULARIZACIONES Y OPERACIONES					
VARIACION DEL NUMERO DE CUOTAS					

1/ Montos en la moneda original que mueven cuotas y que corresponden a ingresos y/o egresos de efectivo en la cuenta caja y bancos de la Cartera Administrada.

2/ Montos en la moneda original que mueven cuotas y que corresponden a aumentos y/o disminuciones que son registrados en cuentas por pagar y/o cuentas por cobrar de la Cartera Administrada.

3/ Valor cuota promedio utilizado para el cálculo del número de cuotas. Resulta de la división entre el Monto en Soles (segunda columna) y el número de cuotas (primera columna).

ANEXO N° III

3. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DE LOS INSTRUMENTOS U OPERACIONES DE INVERSION EN LOS QUE SE HA INVERTIDO LOS RECURSOS DE LA CARTERA ADMINISTRADA.

3.1 INSTRUMENTOS U OPERACIONES DE INVERSION EMITIDOS EN SERIE

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

CODIGO INSTRUMENTO 1/	HORA DE NEGOCIACION	NUMERO DE SECUENCIA 2/	INDICADOR DE MOVIMIENTO 3/	UNIDADES TRANSADAS	PRECIO DE TRANSACCION	FECHA LIQUIDACION 4/	PLAZO LIQUIDACION 5/	INTERMEDIARIO 6/	INDICADOR CAJA 7/	PLAZA NEGOCIACION 8/	MECANISMO DE NEGOCIACION ELECTRÓNICA 9/

1/ Establecido por la Superintendencia, incluye código de valor, código de emisor, código de la moneda y código referencial.

2/ Código que permitirá registrar la compra o venta con un número único, adicionalmente permitirá vincular la operación al Anexo N° V.

3/ Corresponde a la venta (V), redención (R), compra (C), aumento (A), disminución (D), liberadas (L), amortización (M), entradas (E), salidas (S) y otros movimientos que se determine.

4/ Fecha de liquidación de la operación que deberá coincidir con la documentación sustentatoria respectiva.

5/ Plazo para la liquidación de la operación (fecha de liquidación menos fecha del IDI) en número de días.

6/ Nombre del intermediario, ya sea nacional o extranjero. La Superintendencia comunicará los códigos correspondientes para la transmisión electrónica.

7/ Corresponde a movimientos de efectivo en la cuenta caja y bancos de la Cartera Administrada. Se registrará como S en caso **sí** afecte dicha cuenta y N en caso contrario.

8/ Nombre de la plaza donde se ha negociado la operación. La Superintendencia comunicará los códigos correspondientes para la transmisión electrónica.

9/ Nombre del mecanismo de negociación electrónico utilizado en la operación. La Superintendencia comunicará los códigos correspondientes para la transmisión electrónica.

3.2 INSTRUMENTOS U OPERACIONES DE INVERSION EMITIDOS DE MANERA INDIVIDUAL (UNICOS O NO SERIADOS)

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

CODIGO INSTRUMENTO 1/	HORA DE NEGOCIACION	INDICADOR DE MOVIMIENTO 2/	FECHA EMISION (AAAA-MM-DD)	FECHA VENCIMIENTO (AAAA-MM-DD)	VALOR INICIAL O DE ADQUISICION	VALOR AL VENCIMIENTO	TIPO DE TASA 3/	TASA DE INTERES ANUAL	PLAZO LIQUIDACION 4/	BASE ANUAL 5/	METODO DE VALORIZACION 6/	INTERMEDIARIO 7/	INDICADOR CAJA 8/	PLAZA NEGOCIACION 9/

1/ Establecido en coordinación con la Administradora y la Superintendencia, incluye código de valor, código de emisor, código de la moneda y código referencial.

2/ Corresponde a la venta (V), redención (R), compra (C), aumento (A), disminución (D), entradas (E), salidas (S) y otros movimientos que se determine.

3/ Tasa nominal anual (TNA) o tasa efectiva anual (TEA).

4/ Plazo para la liquidación de la operación (fecha de liquidación menos fecha del IDI) en número de días.

5/ Base de cálculo, puede ser de 365 ó 360.

6/ Método de descuento, de principal más intereses o vector. La Superintendencia comunicará los códigos correspondientes para la transmisión electrónica.

7/ Nombre del intermediario, ya sea nacional o extranjero. La Superintendencia comunicará los códigos correspondientes para la transmisión electrónica.

8/ Corresponde a movimientos de efectivo en la cuenta caja y bancos de la Cartera Administrada. Se registrará como S en caso **sí** afecte dicha cuenta y N en caso contrario.

9/ Nombre de la plaza donde se ha negociado la operación. La Superintendencia comunicará los códigos correspondientes para la transmisión electrónica.

ANEXO N° IV

4. DETALLE DEL SALDO Y DE LA CONCILIACION DE LA CUENTA CAJA Y BANCOS DEL BALANCE GENERAL DE LA CARTERA ADMINISTRADA

4.1. STOCK DE CAJA Y BANCOS

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

CODIGO INSTRUMENTO	INSTITUCION	MONEDA	SALDO EFECTIVO	SALDO DIFERIDO	SALDO CONTABLE	TASA DE INTERES	TIPO DE TASA 1/	INTERES DIARIO	BASE ANUAL 2/	INTERESES ACUMULADOS	TOTAL MONEDA ORIGINAL	MONTO TOTAL SOLES
TOTAL CAJA Y BANCOS												

1/ Tasa nominal anual (TNA) o tasa efectiva anual (TEA).

2/ Base de cálculo, puede ser de 365 ó 360.

4.2. FLUJO DE CAJA Y BANCOS

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

		MONTO SOLES	MONTO DOLARES	MONTO EUROS	MONTO LIBRAS	MONTO YENES	MONTO TOTAL SOLES
4.2.1	SALDO DEL DÍA ANTERIOR						
4.2.2	TOTAL INGRESOS						
4.2.2.1	ABONOS INDEBIDOS 1/						
4.2.2.2	ABONOS DE INTERESES DE CUENTAS CORRIENTES						
4.2.2.3	ABONOS POR INTERESES MORATORIOS						
4.2.2.4	APORTES AL ENCAJE MANTENIDO						
4.2.2.5	COBRO DE DERECHOS EN EFECTIVO POR INVERSIONES 2/						
4.2.2.6	DISMINUCIÓN DE CUENTAS POR COBRAR POR INVERSIONES 3/						
4.2.2.7	DISMINUCIÓN DE CUENTAS POR COBRAR POR OTROS CONCEPTOS 4/						
4.2.2.8	INGRESOS REALIZADOS POR TRASPASOS						
4.2.2.9	INTERES ACUMULADOS EN CUENTAS CORRIENTES 5/						
4.2.2.10	OPERACIONES DE COMPRA Y/O VENTA DE MONEDAS						
4.2.2.11	RECAUDACIÓN DE APORTES						
4.2.2.12	REDEMCIÓN BONOS DE RECONOCIMIENTO						
4.2.2.13	REDEMCIÓN O VENCIMIENTOS DE INVERSIONES						
4.2.2.14	REINTEGRO DE CARGOS INDEBIDOS						
4.2.2.15	TRANSFERENCIAS DEL EXTERIOR						
4.2.2.16	VENTA DE INVERSIONES 6/						
4.2.2.17	INGRESOS POR REZAGOS						
4.2.2.18	OTROS INGRESOS						
4.2.3	TOTAL EGRESOS						
4.2.3.1	APERTURAS O RENOVACIONES DE INVERSIONES						
4.2.3.2	CARGOS INDEBIDOS 1/						
4.2.3.3	COMPRA DE INVERSIONES 6/						
4.2.3.4	DEVOLUCIÓN DE ABONO INDEBIDO						
4.2.3.5	DISMINUCIÓN DE CUENTAS POR PAGAR POR INVERSIONES 3/						
4.2.3.6	DISMINUCIÓN DE CUENTAS POR PAGAR POR OTROS CONCEPTOS 4/						
4.2.3.7	DISMINUCIÓN DE INTERESES ACUMULADOS DE CUENTAS CORRIENTES						
4.2.3.8	EGRESOS REALIZADOS POR TRASPASOS						
4.2.3.9	EXTORRONS DE RECAUDACIÓN						
4.2.3.10	OPERACIONES DE COMPRA Y/O VENTA DE MONEDAS						
4.2.3.11	PAGO DE BENEFICIOS						
4.2.3.12	PAGO DE OBLIGACIONES DE INVERSIONES						
4.2.3.13	RETROS DEL ENCAJE MANTENIDO						
4.2.3.14	TRANSFERENCIAS AL EXTERIOR						
4.2.3.15	NULIDAD						
4.2.3.16	MULTIAFILIAION						
4.2.3.17	DEVOLUCIÓN DE EXCESOS						
4.2.3.18	OTROS EGRESOS						
4.2.4	SALDO FINAL DEL DÍA						

1/ Corresponden a todos los abonos y cargos no identificados o sin documentación sustentatoria.

2/ El término inversiones, en este anexo, incluye a los instrumentos u operaciones de inversión realizados con los recursos de las Carteras Administradas.

3/ Se refiere a las cuentas provisionadas originadas por transacciones de inversiones que se liquidan en la fecha del IDI.

4/ Se refiere a las cuentas provisionadas originadas por transacciones que no corresponden a inversiones que se liquidan en la fecha del IDI.

5/ Son los intereses diarios acumulados desde el primer día del mes vigente hasta la fecha del IDI, de todas las cuentas corrientes remuneradas.

6/ Son los movimientos de caja debido a la compra o venta de las inversiones que se liquidan el mismo día de la transacción (en la fecha del IDI).

ANEXO N° V

5. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DE LAS CUENTAS POR COBRAR Y DE LAS CUENTAS POR PAGAR DEL BALANCE GENERAL DE LA CARTERA ADMINISTRADA.

5.1 CUENTAS POR COBRAR

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

SALDO DEL DIA ANTERIOR								
CODIGO CUENTA POR COBRAR 1/	FECHA REGISTRO (AAAA-MM-DD) 2/	NUMERO SECUENCIA 3/	INDICADOR MOVIMIENTO 4/	CONCEPTO 5/	DETALLE 6/	MONTO (MONEDA ORIGINAL)	INDICADOR CAJA 7/	MONTO SOLES
TOTAL MOVIMIENTOS								
SALDO FINAL DEL DIA								

5.2 CUENTAS POR PAGAR

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

SALDO DEL DIA ANTERIOR								
CODIGO CUENTA POR PAGAR 1/	FECHA REGISTRO (AAAA-MM-DD) 2/	NUMERO SECUENCIA 3/	INDICADOR MOVIMIENTO 4/	CONCEPTO 5/	DETALLE 6/	MONTO (MONEDA ORIGINAL)	INDICADOR CAJA 7/	MONTO SOLES
TOTAL MOVIMIENTOS								
SALDO FINAL DEL DIA								

1/ Los códigos de cuentas por cobrar y cuentas por pagar mantienen la siguiente estructura: TT-VV-EEEE-M-RRRRR.

TT: CC para las cuentas por cobrar y CP para las cuentas por pagar.

VV: en el caso de inversiones será el mismo código de valor del instrumento de inversión, en el caso de otras operaciones que no sean de inversiones el código será 91 para las cuentas por cobrar y 92 para las cuentas por pagar.

EEEE: en el caso de inversiones será el mismo código de emisor del instrumento de inversión, en el caso de operaciones de beneficios, u otras transacciones u operaciones que no sean de inversiones los códigos serán: BENE, OTRO, respectivamente.

M: código de moneda.

RRRRR: en el caso de inversiones será el mismo código referencial del instrumento de inversión, en el caso de transacciones u operaciones que no sean de inversiones el código referencial será 00001.

2/ Es la fecha del registro inicial de la cuenta por cobrar o la cuenta por pagar en el IDI.

3/ Número de secuencia establecido en el Anexo III. Permitirá su identificación en este anexo.

4/ Puede ser aumento (A) o disminución (D).

5/ Concepto de la transacción u operación de la Cartera Administrada. La Superintendencia comunicará los códigos correspondientes para la transmisión electrónica.

6/ Información más detallada de la cuenta. La Superintendencia comunicará los códigos correspondientes para la transmisión electrónica.

7/ Corresponde a movimientos de efectivo en la cuenta caja y bancos de la Cartera Administrada. Se registrará como S en caso si afecte dicha cuenta y N en caso contrario.



SUPERINTENDENCIA
DE BANCA, SEGUROS Y AFP

PREPUBLICACIÓN

ANEXO N° VI

6. DETALLE DEL COBRO DE DERECHOS Y DEL PAGO DE OBLIGACIONES GENERADOS POR LOS INSTRUMENTOS U OPERACIONES DE INVERSIÓN EN LOS QUE SE HA INVERTIDO LOS RECURSOS DE LA CARTERA ADMINISTRADA 1/.

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

CODIGO INSTRUMENTO	INDICADOR MOVIMIENTO 2/	FECHA LIQUIDACION 3/	PLAZO LIQUIDACION 4/	TENENCIA DIA ANTERIOR	FACTOR 5/	MONEDA 6/	TOTAL (EN MONEDA ORIGINAL)	INDICADOR CAJA 7/	TOTAL SOLES

1/ Cada vez que se cobra (paga) o se provisiona un derecho o una obligación.

2/ Se refiere a la entrega de intereses (I), amortizaciones (A), redenciones (R), dividendos (D), rebates (B), otros derechos en efectivo (E) pago de impuestos (T) y otros pagos (P). Dichos indicadores podrán ser ampliados.

3/ Fecha en la cual se deberá hacer la entrega en efectivo de los derechos correspondientes a las carteras administradas.

4/ Plazo para la liquidación (fecha de liquidación menos fecha del IDI) en número de días.

5/ Es el factor por el cual se deberá multiplicar la tenencia del día anterior para obtener el derecho (obligación) que corresponde al fondo.

6/ Moneda original en la que se genera el derecho (obligación).

7/ Corresponde a movimientos de efectivo en la cuenta caja y bancos de la Cartera Administrada. Se registrará como S en caso sí afecte dicha cuenta y N en caso contrario.



SUPERINTENDENCIA
DE BANCA, SEGUROS Y AFP

PREPUBLICACIÓN

ANEXO N° VII

7. DETALLE DE LAS OPERACIONES DE COMPRA Y VENTA DE MONEDAS REALIZADAS CON LOS RECURSOS DE LA CARTERA ADMINISTRADA.

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

CODIGO DE EMISOR 1/	HORA DE NEGOCIACION	MONEDA COMPRA 2/	MONTO COMPRA	MONEDA VENTA 3/	MONTO VENTA	TIPO CAMBIO 4/	FECHA DE LIQUIDACION 5/	PLAZO LIQUIDACION 6/	INDICADOR CAJA 7/	PLAZA NEGOCIACION 8/

1/ El código de emisor de la institución con la que se realiza la operación, el mismo que forma parte del código de instrumento.

2/ Moneda que compra el fondo.

3/ Moneda que vende el fondo.

4/ Tipo de cambio de la operación y que figura en el documento sustentatorio.

5/ Fecha de liquidación de la operación que deberá coincidir con la documentación sustentatoria respectiva.

6/ Plazo para la liquidación (fecha de liquidación menos fecha del IDI) en número de días.

7/ Corresponde a movimientos de efectivo en la cuenta caja y bancos de la Cartera Administrada. Se registrará como S en caso sí afecte dicha cuenta y N en caso contrario.

8/ Nombre de la plaza donde se ha negociado la operación. La Superintendencia comunicará los códigos correspondientes para la transmisión electrónica.



SUPERINTENDENCIA
DE BANCA, SEGUROS Y AFP

PREPUBLICACIÓN

ANEXO N° VIII

**8. DETALLE DE LOS INSTRUMENTOS U OPERACIONES DE INVERSIÓN DE LA CARTERA ADMINISTRADA
MANTENIDOS EN GUARDA FÍSICA 1/.**

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

CODIGO DE INSTRUMENTO	CANTIDAD DE INSTRUMENTOS (A)	INSTRUMENTOS EN TRÁNSITO (B) 2/	TOTAL (A)+(B)	ENTIDAD DE GUARDA FÍSICA 3/	VALORIZACIÓN

TOTAL GUARDA FÍSICA:

1/ Para cada entidad de guarda física.

2/ Los instrumentos de inversión que a la fecha no hayan sido liquidados.

3/ La Superintendencia comunicará los códigos correspondientes para la transmisión electrónica.

ANEXO IX

9. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DE LOS CONTRATOS DE DERIVADOS.

9.A. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DE LOS CONTRATOS DE FORWARDS.

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

CODIGO INSTRUMENTO 1	USO DEL DERIVADO 2	TIPO DE GEP 3	HORA DE NEGOCIACION 4	NUMERO DE SECUENCIA 5	INDICADOR DE MOVIMIENTO 6	TIPO DE FORWARD 7	SUBYACENTE COMPRADO 8	SUBYACENTE VENDIDO 9	PRECIO PACTADO 10	TASA VARIABLE 11	VALOR NOCIONAL 12	MONEDA DEL VALOR NOCIONAL 13	FECHA DE NEGOCIACION 14	FECHA DE INICIO 15	FECHA VENCIMIENTO 16	FECHA DE LIQUIDACION 17	MONEDA DE LIQUIDACION 18	PRECIO DE LIQUIDACION 19	MODALIDAD DE PAGO 20	CODIGO INSTRUMENTO CHEAPEST TO DELIVER 21	PRECIO DE CHEAPEST TO DELIVER 22	INTERMEDIARIO DE NEGOCIACION 23	CLEARER BROKER 24	CAMARA DE COMPENSACION 25	PLAZA NEGOCIACION 26	MEDIO DE CONCERTACION 27

Notas:

- 1/ Corresponde al código de valor, código de emisor, código de la moneda y código referencial del instrumento derivado.
2/ Corresponde al uso que se le dará al forward al interior de las Carteras Administradas. Se deberá registrar: Cobertura (COB), Gestión Eficiente del Portafolio (GEP), o Cierre de Posición (CPOS).
3/ Corresponde al tipo de gestión eficiente de portafolio para el cual es usado el forward: Reducir o mitigar riesgo relativo (RASL), mitigar riesgos con riesgo de base moderado (BSL), y, generación de ganancias (GSL).
4/ Corresponde a la hora de realización de la operación.
5/ Código que permitirá registrar la compra o venta con un número único, adicionalmente permitirá vincular la operación al Anexo N° V del IDI.
6/ Corresponde a la redención o cancelación anticipada (RA), redención o vencimiento (R), apertura (A), incremento (I) y disminución (D) del instrumento derivado.
7/ Corresponde a un Forward de Compra (C) o a un Forward de Venta (V).
8/ Corresponde al código vector del activo subyacente comprado.
9/ Corresponde al código vector del activo subyacente vendido.
10/ Corresponde al precio pactado del forward. En caso que el activo subyacente comprado o vendido corresponda a una tasa de interés fija se registrará el valor de la tasa en porcentaje.
11/ Corresponde a la tasa de interés variable inicial, en caso que el forward tenga como activo subyacente comprado o vendido una tasa de interés variable. Se registra en porcentaje y sólo en el supuesto antes indicado.
12/ Corresponde al valor notional del forward.
13/ Corresponde al código de vector de la moneda del valor notional.
14/ Corresponde a la fecha de negociación del Forward. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
15/ Corresponde a la fecha efectiva de inicio del forward. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
16/ Corresponde a la fecha de vencimiento del forward. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
17/ Corresponde a la fecha de liquidación o settlement de la operación. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
18/ Corresponde al código de vector de la moneda de liquidación al vencimiento de la operación.
19/ Corresponde al precio de liquidación o fixing con el cual se estima la ganancia o pérdida del instrumento derivado al momento de la liquidación del forward. Registrar en caso de redención o cancelación anticipada o, redención o vencimiento.
20/ Corresponde a Cash Settlement (CS), Delivery (D) o Non Delivery (ND).
21/ Corresponde al código de valor, código de emisor, código de la moneda y código referencial del instrumento Cheapest to Deliver en caso de instrumentos derivados sobre bonos.
22/ Precio limpio del instrumento Cheapest to Deliver en caso de instrumentos derivados sobre bonos.
23/ Corresponde al código vector del intermediario de negociación, en caso corresponda. Esto resulta aplicable en caso las operaciones sean compensadas y liquidadas por cámaras de compensación.
24/ Corresponde al código vector del clearer broker (entidad liquidadora), en caso corresponda. Esto resulta aplicable en caso las operaciones sean compensadas y liquidadas por cámaras de compensación.
25/ Corresponde al código vector de la cámara de compensación en caso corresponda.
26/ Corresponde al código vector de la Bolsa de Derivados, en caso corresponda.
27/ Corresponde al código correspondiente a la SBS del mecanismo de negociación electrónico utilizado en la operación. En caso la operación haya sido concertada por teléfono se registrará: "T".

ANEXO IX

9. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DE LOS CONTRATOS DE DERIVADOS.

9.8. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DE LOS CONTRATOS DE FUTUROS

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA:AAAA-MM-DD:

CÓDIGO INSTRUMENTO 1)	TICKER 2)	USO DEL DERIVADO 3)	TIPO DE GEP 4)	HORA DE NEGOCIACIÓN 5)	NÚMERO DE SECUENCIA 6)	INDICADOR DE MOVIMIENTO 7)	TIPO DE FUTURO 8)	SUBYACENTE COMPRADO 9)	SUBYACENTE VENDIDO 10)	PRECIO PACTADO 11)	TASA VARIABLE 12)	VALOR NOCIONAL 13)	MONEDA DEL VALOR NOCIONAL 14)	NÚMERO DE CONTRATOS 15)	UNIDADES DEL SUBYACENTE POR CONTRATO 16)	FECHA DE NEGOCIACIÓN 17)	FECHA DE INICIO 18)	FECHA VENCIMIENTO 19)	FECHA DE LIQUIDACIÓN 20)	MONEDA DE LIQUIDACIÓN 21)	PRECIO DE LIQUIDACIÓN 22)	MODALIDAD DE PAGO 23)	CÓDIGO INSTRUMENTO CHEAPEST TO DELIVER 24)	PRECIO DE CHEAPEST TO DELIVER 25)	INTERMEDIARIO DE NEGOCIACIÓN 26)	CLEARER BROWER 27)	CÁMARA DE COMPENSACIÓN 28)	PLAZA NEGOCIACIÓN 29)	MEDIO DE CONCERTACIÓN 30)

- Notas:
- 1) Corresponde al código de valor, código de emisor, código de la moneda y código referencial del instrumento derivado.
 - 2) Corresponde al código asignado al futuro por el mecanismo centralizado de negociación. Usar el ticker asignado en Bloomberg.
 - 3) Corresponde al uso que se le dará al futuro al interior de las Carteras Administradas. Se deberá registrar: Cobertura (COB), Gestión Eficiente del Portafolio (GEP), o Cierre de Posición (CPPOS).
 - 4) Corresponde al tipo de gestión eficiente de portafolio para el cual es usado el futuro: Reducir o mitigar riesgo relativo (RAESL), mitigar riesgo con riesgo de base moderado (RBESL), y operación de ganancias (GOSL).
 - 5) Corresponde a la hora de realización de la operación.
 - 6) Código que permitirá registrar la compra o venta con un número único, adicionalmente permitirá vincular la operación al Anexo N° V del IDL.
 - 7) Corresponde a la redención o cancelación anticipada (RA), redención o vencimiento (RV), apertura (A), incremento (I) y disminución (D) del instrumento derivado.
 - 8) Corresponde a un futuro de compra (C) o a un futuro de venta (V).
 - 9) Corresponde al código vector del activo subyacente comprado.
 - 10) Corresponde al código vector del activo subyacente vendido.
 - 11) Corresponde al precio pactado del futuro.
 - 12) Corresponde a la tasa de interés variable inicial, en caso que el futuro tenga como activo subyacente contratado o vendido una tasa de interés variable. Se registra en conciente y sólo en el subsector antes indicado.
 - 13) Corresponde al valor nocional del futuro.
 - 14) Corresponde al código de vector de la moneda del valor nocional.
 - 15) Se registrará el número de contratos adquiridos.
 - 16) En caso correspondiente se registrará las unidades del activo subyacente por cada contrato. Por ejemplo, se registrará: 100 acciones.
 - 17) Corresponde a la fecha de negociación del futuro. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
 - 18) Corresponde a la fecha efectiva de inicio del futuro. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
 - 19) Corresponde a la fecha de vencimiento del futuro. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
 - 20) Corresponde a la fecha de liquidación o settlement de la operación. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
 - 21) Corresponde al código de vector de la moneda de liquidación al vencimiento de la operación.
 - 22) Corresponde al precio de liquidación o precio con el cual se estima la suficiencia o suficiencia del instrumento derivado al momento de la liquidación del futuro. Registrar en caso de redención o cancelación anticipada o redención o vencimiento.
 - 23) Corresponde a Cash Settlement (CS), Delivery (D) o Non Delivery (ND).
 - 24) Corresponde al código de valor, código de emisor, código de la moneda y código referencial del instrumento Cheapest to Deliver en caso de instrumentos derivados sobre bonos.
 - 25) Precio limbo del instrumento Cheapest to Deliver en caso de instrumentos derivados sobre bonos.
 - 26) Corresponde al código vector del intermediario de negociación.
 - 27) Corresponde al código vector del clear (intermediario liquidador).
 - 28) Corresponde al código vector de la cámara de compensación.
 - 29) Corresponde al código vector de la Bolsa de Comercio.
 - 30) Corresponde al código correspondiente a la SBS del mecanismo de negociación electrónico utilizado en la operación. En caso la operación haya sido concertada por teléfono se registrará: "T".

ANEXO IX

9. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DE LOS CONTRATOS DE DERIVADOS.

9.C. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DE LOS CONTRATOS DE OPCIONES

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

CODIGO INSTRUMENTO 1/	TICKER 2/	USO DEL DERIVADO 3/	TIPO DE GEP 4/	HORA DE NEGOCIACIÓN 5/	NÚMERO DE SECUENCIA 6/	INDICADOR DE MOVIMIENTO 7/	TIPO DE OPCIÓN 8/	ACTIVO SUBYACENTE 9/	VALOR NOCIONAL 10/	MONEDA DEL VALOR NOCIONAL 11/	PRIMA PACTADA 12/	MONEDA DE LA PRIMA PACTADA 13/	PRECIO STRIKE 14/	NÚMERO DE CONTRATOS 15/	UNIDADES DEL SUBYACENTE POR CONTRATO 16/	FECHA DE NEGOCIACIÓN 17/	FECHA DE RÍDIO 18/	FECHA VENCIMIENTO 19/	FECHA DE LIQUIDACIÓN 20/	MONEDA DE LIQUIDACIÓN 21/	PRECIO DE LIQUIDACIÓN 22/	INTERMEDIARIO DE NEGOCIACIÓN 23/	CLEARER BROKER 24/	CAMARA DE COMPENSACIÓN 25/	PLAZA NEGOCIACIÓN 26/	MEDIO DE CONCERTACIÓN 27/

Notas:
1/ Corresponde al código de valor, código de emisor, código de la moneda y código referencial de los contratos de opciones.
2/ Corresponde al código asignado al contrato de opciones en caso negocie en un mecanismo centralizado de negociación. Usar el ticker asignado en Bloomberg.
3/ Corresponde al uso que se le dará al instrumento derivado al interior de las Carteras Administradas. Se deberá registrar: Cobertura (COB) o Gestión Eficiente del Portafolio (GEP).
4/ Corresponde al tipo de gestión eficiente de portafolio para el cual es usado el futuro: Reducir o mitigar riesgo relativo (ZASL), mitigar riesgos con riesgo de base moderado (ZBSL), y, generación de ganancias (ZCSL).
5/ Corresponde a la hora de realización de la operación.
6/ Código que permitirá registrar la compra o venta con un número único, adicionalmente permitirá vincular la operación al Anexo N° V del IDL.
7/ Corresponde a la cancelación anticipada(RA), vencimiento (R), compra (C), venta (V), incremento (I) y disminución (D) del contrato de opciones.
8/ Corresponde a una Opción de Compra (C) o una Opción de Venta (P).
9/ Corresponde al código vector del activo subyacente de la opción de compra o venta.
10/ Corresponde al valor notional del instrumento derivado.
11/ Corresponde al código de moneda del valor notional.
12/ Corresponde al valor de la prima pacta del instrumento derivado.
13/ Corresponde al código de moneda de la prima pactada.
14/ Corresponde al precio de ejercicio del contrato de opciones.
15/ Se registrará el número de contratos adquiridos.
16/ En caso correspondiente se registrará las unidades del activo subyacente por cada contrato. Por ejemplo, se registrará: 100 acciones.
17/ Corresponde a la fecha de negociación de la opción. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
18/ Corresponde a la fecha efectiva de inicio de la opción. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
19/ Corresponde a la fecha de vencimiento de la opción. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
20/ Corresponde a la fecha de liquidación o settlement de la operación. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
21/ Corresponde al código de vector de la moneda de liquidación al vencimiento de la operación.
22/ Corresponde al precio del activo subyacente mediante el cual se ejerce la opción. Registrar en caso de cancelación anticipada o vencimiento.
23/ Corresponde al código vector del intermediario de negociación, en caso corresponda. Esto resulta aplicable en caso las operaciones sean compensadas y liquidadas por cámaras de compensación.
24/ Corresponde al código vector del (clearer/broker (entidad liquidadora), en caso corresponda. Esto resulta aplicable en caso las operaciones sean compensadas y liquidadas por cámaras de compensación.
25/ Corresponde al código vector de la cámara de compensación en caso corresponda.
26/ Corresponde al código vector de la Bolsa de Derivados, en caso corresponda.
27/ Corresponde al código correspondiente a la SBS del mecanismo de negociación electrónico utilizado en la operación. En caso la operación haya sido concertada por teléfono se registrará: "T".

9. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DE LOS CONTRATOS DE DERIVADOS.

9.D. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DE LOS CONTRATOS DE SWAPS

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:

FECHA:AAAA-MM-DD:

CODIGO INSTRUMENTO 1	USO DEL DERIVADO 2	TIPO DE GEP 3	HORA DE NEGOCIACION 4	NUMERO DE SECUENCIA 5	INDICADOR DE MOVIMIENTO 6	SUBYACENTE PAGADO 7	TASA DE INTERÉS PAGADA 8	SUBYACENTE RECIBIDO 9	TASA DE INTERÉS RECIBIDA 10	VALOR NOCIONAL A PAGAR 11	VALOR NOCIONAL A RECIBIR 12	TIPO DE CAMBIO PACTADO 13	FECHA DE NEGOCIACION 14	FECHA DE INICIO 15	FECHA VENCIMIENTO 16	FECHA PRIMER PAGO SUBYACENTE PAGADO 17	PERIODICIDAD DEL INTERCAMBIO SUBYACENTE PAGADO 18	MONEDA DE LIQUIDACION SUBYACENTE PAGADO 19	FECHA PRIMER PAGO SUBYACENTE RECIBIDO 20	PERIODICIDAD DEL INTERCAMBIO SUBYACENTE RECIBIDO 21	MONEDA DE LIQUIDACION SUBYACENTE RECIBIDO 22	INTERMEDARIO DE NEGOCIACION 23	CLEARER BROKER 24	CAMARA DE COMPENSACION 25	PLAZA DE NEGOCIACION 26	MEDO DE CONCERTACION 27

Notas:
1) Corresponde al código de valor único de emisión; código de la moneda y código referencial del instrumento derivado.
2) Corresponde al uso que se le dará al swap al interior de las Carteras Administradas. Se deberá registrar: Cobertura (COB), Gestión Eficiente del Portafolio (GEP), o Cierre de Posición (CPOS).
3) Corresponde al tipo de gestión eficiente de portafolio para el cual es usado el swap. Reducir o mitigar riesgo relativo (RA3), mitigar riesgos con riesgo de base moderado (RB3), o combinación de variancias (DC3).
4) Corresponde a la hora de realización de la operación.
5) Códigos que permitirá registrar la compra o venta con un número único, adicionalmente permitirá vincular la operación al Anexo N° V del ID.
6) Corresponde a la redención o cancelación anticipada (RA), redención o vencimiento (R), apertura (C), incremento (I) y disminución (D) del instrumento derivado.
7) Corresponde al código vector del activo subyacente comprado.
8) Corresponde a la tasa de interés fija o tasa de interés variable inicial aplicable al primer intercambio. En caso el activo subyacente contratado no corresponda a una tasa fija ni variable, no resultará aplicable el llenado de este campo.
9) Corresponde al código vector del activo subyacente vendido.
10) Corresponde a la tasa de interés fija o tasa de interés variable inicial aplicable al primer intercambio. En caso el activo subyacente contratado no corresponda a una tasa fija ni variable, no resultará aplicable el llenado de este campo.
11) Corresponde al monto del valor notional del subyacente a comprar.
12) Corresponde al monto del valor notional del subyacente a vender.
13) Corresponde al tipo de cambio correspondiente al intercambio de flujos del swap, en caso resulte aplicable.
14) Corresponde a la fecha de negociación del swap. Exprimado en formato: dd-mm-aaaa.
15) Corresponde a la fecha efectiva de inicio del swap. Exprimado en formato: dd-mm-aaaa.
16) Corresponde a la fecha de vencimiento del swap. Exprimado en formato: dd-mm-aaaa.
17) Corresponde a la fecha del primer pago que realizará la AFP. Exprimado en formato: dd-mm-aaaa.
18) Corresponde a la periodicidad del swap que realizará la AFP. Debe estar expresado en meses, por ejemplo si la AFP opera trimestralmente, se deberá registrar "3".
19) Corresponde al código de vector de la moneda de liquidación de los pagos que se realizará.
20) Corresponde a la fecha del primer pago que recibirá la AFP. Exprimado en formato: dd-mm-aaaa.
21) Corresponde a la periodicidad del swap que recibirá la AFP. Debe estar expresado en meses, por ejemplo si la AFP recibe el swap trimestralmente, se deberá registrar "3".
22) Corresponde al código de vector de la moneda de liquidación de los pagos que se recibirá.
23) Corresponde al código vector del intermediario de negociación, en caso corresponda. Esto resulta aplicable en caso las operaciones sean compensadas y liquidadas por cámaras de compensación.
24) Corresponde al código vector del clearer broker (entidad liquidadora), en caso corresponda. Esto resulta aplicable en caso las operaciones sean compensadas y liquidadas por cámaras de compensación.
25) Corresponde al código vector de la cámara de compensación en caso corresponda.
26) Corresponde al código vector de la Bolsa de Derivados, en caso corresponda.
27) Corresponde al código correspondiente a la SBS del mecanismo de negociación electrónico utilizado en la operación. En caso la operación haya sido concertada por teléfono se registrará "T".

ANEXO IX

9. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DE LOS CONTRATOS DE DERIVADOS.

9.E. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DE LOS CONTRATOS DE CREDIT DEFAULT SWAPS

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

CÓDIGO INSTRUMENTO 1/	USO DEL DERIVADO 2/	HORA DE NEGOCIACIÓN 3/	NÚMERO DE SECUENCIA 4/	INDICADOR DE MOVIMIENTO 5/	PRIMA PAGADA 6/	CÓDIGO ACTIVO SUBYACENTE DE REFERENCIA 7/	TASA DE RECUPERIO 8/	VALOR NOCIONAL 9/	MONEDA DEL VALOR NOCIONAL 10/	FECHA DE NEGOCIACIÓN 11/	FECHA DE INICIO 12/	FECHA VENCIMIENTO 13/	PERIODICIDAD DE PAGO DE LA PRIMA 14/	FECHA PRIMER PAGO DE LA PRIMA 15/	MONEDA DE PAGO DE LA PRIMA 16/	FECHA DEL EVENTO DE DEFAULT 17/	FECHA DE LIQUIDACIÓN EVENTO DE DEFAULT 18/	MONTO PAGADO EVENTO DEFAULT 19/	MONEDA DE PAGO EVENTO DEFAULT 20/	INTERMEDIARIO DE NEGOCIACIÓN 21/	CLEARER BROKER 22/	CÁMARA DE COMPENSACIÓN 23/	PLAZA NEGOCIACIÓN 24/	MEDO DE CONCERTACIÓN 25/

Notas:
1/ Corresponde al código de valor, código de emisor, código de la moneda y código referencial del instrumento derivado.
2/ Corresponde al uso que se le dará al swap al interior de las Carteras Administradas. Se deberá registrar: Cobertura (COB) o Cierre de Posición (CPOS).
3/ Corresponde a la hora de realización de la operación.
4/ Código que permitirá registrar la compra o venta con un número único, adicionalmente permitirá vincular la operación al Anexo N° V del IDI.
5/ Corresponde a la redención o cancelación anticipada (RA), redención o vencimiento (R), apertura (C), incremento (I) y disminución (D) del instrumento derivado.
6/ Corresponde al porcentaje de prima anual pagada a la contraparte.
7/ Corresponde al código vector del título de deuda de referencia para el pago que realiza la contraparte en caso de default.
8/ Corresponde al ratio del valor del título de deuda inmediatamente luego de ocurrir el default sobre el valor nominal del instrumento. En términos prácticos, en caso de default la contraparte pagará 100/1-Tasa de recupero.
9/ Corresponde al valor notional del credit default swap.
10/ Corresponde al código de vector de la moneda del valor notional.
11/ Corresponde a la fecha de negociación del credit default swap. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
12/ Corresponde a la fecha efectiva de inicio del credit default swap. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
13/ Corresponde a la fecha de vencimiento del credit default swap. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
14/ Corresponde a la periodicidad del pago de la prima que realizará la AFP. Debe estar expresado en meses, por ejemplo si la AFP paga trimestralmente, se deberá registrar "3".
15/ Corresponde a la fecha del primer pago que realizará la AFP. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
16/ Corresponde al código de vector de la moneda de pago de la prima.
17/ Corresponde a la fecha del evento de default que genera un caso de la contraparte. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
18/ Corresponde a la fecha de pago de la contraparte. Expresado en formato: dd-mm-aaaa.
19/ Corresponde al monto de pago de la contraparte, expresado en la moneda indicada en 20.
20/ Corresponde al código de vector de la moneda de pago de la contraparte.
21/ Corresponde al código vector del intermediario de negociación, en caso correspondiente. Esto resulta aplicable en caso las operaciones sean compensadas y liquidadas por cámaras de compensación.
22/ Corresponde al código vector del clearin/broker (entidad liquidadora), en caso correspondiente. Esto resulta aplicable en caso las operaciones sean compensadas y liquidadas por cámaras de compensación.
23/ Corresponde al código vector de la cámara de compensación en caso correspondiente.
24/ Corresponde al código vector de la Bolsa de Derivados, en caso correspondiente.
25/ Corresponde al código correspondiente a la SBS del mecanismo de negociación electrónico utilizado en la operación. En caso la operación haya sido concertada por teléfono se registrará "T".

ANEXO X

10. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DEL MARGEN DE GARANTÍA Y COLATERAL DE LOS CONTRATOS DE DERIVADOS.

10.A. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DEL MÁRGEN DE GARANTÍA DE LOS CONTRATOS DE DERIVADOS QUE LIQUIDAN A TRAVÉS DE CÁMARAS DE COMPENSACIÓN

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

CAMARA DE COMPENSACIÓN 1/	PLAZA NEGOCIACION 2/	CLEARER BROKER 3/	CODIGO DE CUENTA 4/	TIPO DE COLATERAL 5/	FORMA DE PAGO 6/	MONEDA DE MÁRGEN DE GARANTÍA 7/	NÚMERO DE OPERACIONES 8/	GANANCIA/PÉRDIDA DIARIA 9/	GANANCIA/PÉRDIDA DIARIA ACUMULADA 10/	MARGEN DE GARANTÍA INICIAL 11/	MARGEN DE MANTENIMIENTO 12/	MOVIMIENTO DE MÁRGEN DE GARANTÍA 13/	TASA DE INTERÉS 14/	INTERÉS DIARIO 15/	INTERÉS ACUMULADO 16/	CUENTA DE BALANCE MÁRGEN DE GARANTÍA 17/	CÓDIGO DE INSTRUMENTO MARGEN 18/	UNIDADES DEL INSTRUMENTO MARGEN 19/	MONTO EN EFECTIVO MARGEN 20/

Notas:
1/ Corresponde al código vector de la cámara de compensación.
2/ Corresponde al código vector de la Bolsa de Derivados.
3/ Corresponde al código vector del clearer broker (entidad liquidadora) por cámaras de compensación.
4/ Corresponde al código de valor, código de emisor, código de la moneda y código referencial, correspondiente a la cuenta de margen de garantía.
5/ Corresponde a los siguientes códigos: Deudor (D) ó Acreedor (A).
6/ Corresponde a los siguientes códigos: Cash (C), Instrumento de Inversión (I), o Cash e Instrumentos de Inversión (M).
7/ Corresponde al código de vector de la moneda del margen de garantía.
8/ Corresponde al número de operaciones de derivados sobre las cuales se está colocando el margen de garantía.
9/ Corresponde a la ganancia o pérdida diaria de los instrumentos derivados sobre los cuales se genera margen de garantía. En el caso que sea pérdida se registrará un valor negativo.
10/ Corresponde a la ganancia o pérdida diaria acumulada de los instrumentos derivados sobre los cuales se genera margen de garantía. En el caso que sea pérdida se registrará un valor negativo.
11/ Corresponde al margen de garantía inicial.
12/ Corresponde al margen de mantenimiento del margen de garantía.
13/ Corresponde al movimiento de la cuenta de margen de garantía. En el caso de un margen de variación se registrará un valor positivo y en el caso de un retro de margen se registrará un valor negativo.
14/ Corresponde a la tasa de interés nominal anual que remunera la cuenta de margen de garantía.
15/ Corresponde al monto de interés diario de la cuenta de margen de garantía.
16/ Corresponde al monto de interés acumulado de la cuenta de margen de garantía.
17/ Corresponde al saldo final de la cuenta de margen de garantía.
18/ Corresponde al código de valor, código de emisor, código de la moneda y código referencial del instrumento entregado o recibido como margen de garantía.
19/ Corresponde al número de unidades del instrumento señalado en 18, entregado o recibido como margen de garantía.
20/ Corresponde al monto de efectivo colocado o recibido como margen de garantía.

ANEXO X

10. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DEL MARGEN DE GARANTÍA Y COLATERAL DE LOS CONTRATOS DE DERIVADOS.

10.B. DETALLE DE LOS MOVIMIENTOS DIARIOS DEL COLATERAL DE LOS CONTRATOS DE DERIVADOS BILATERALES

NOMBRE DE LA CARTERA ADMINISTRADA:
FECHA(AAAA-MM-DD):

CÓDIGO DE CONTRAPARTE 1/	CÓDIGO DE CUENTA 2/	TIPO DE COLATERAL 3/	FORMA DE PAGO 4/	MONEDA DE COLATERAL 5/	NÚMERO DE OPERACIONES 6/	VALOR DE MERCADO DERIVADOS 7/	THRESHOLD 8/	CANTIDAD MÍNIMA DE TRANSFERENCIA 9/	CANTIDAD DE REDONDEO 10/	COLATERAL INICIAL 11/	LLAMADA A COLATERAL 12/	TASA DE INTERÉS 13/	INTERÉS DIARIO 14/	INTERÉS ACUMULADO 15/	TOTAL CUENTA COLATERAL 16/	CÓDIGO DE INSTRUMENTO COLATERAL 17/	UNIDADES DEL INSTRUMENTO COLATERAL 18/	MONTO EN EFECTIVO COLATERAL 19/

Notas:

- 1/ Corresponde al código de la contraparte de los instrumentos derivados.
2/ Corresponde al código de valor, código de emisor, código de la moneda y código referencial, correspondiente a la cuenta de colateral.
3/ Corresponde a los siguientes códigos: Deudor (D) ó Acreedor (A). Se considera deudor cuando la suma de los valores de mercado de los instrumentos derivados es negativa y, acreedor cuando la suma del valor de mercado de los instrumentos derivados es positiva.
4/ Corresponde a los siguientes códigos: Cash (C), Instrumento de Inversión (I), o Cash e Instrumentos de Inversión (M).
5/ Corresponde al código de vector de la moneda del colateral.
6/ Corresponde al número de operaciones de derivados relacionados al colateral colocado.
7/ Corresponde a la suma de los valores de mercado de los instrumentos derivados que se sujetan al Contrato Marco. Se considera la valorización proporcionada por la contraparte, expresada en la moneda definida en 2.
8/ Corresponde a la cantidad sobre la cual la contraparte o el fondo de pensiones, pondrá colateral. Dicha información se encuentra registrada en el Credit Support Annex (CSA) o documento equivalente. Cuando sea un colateral deudor, se registrará el threshold de la AFP y en caso contrario, el de la contraparte.
9/ Corresponde a la cantidad mínima de transferencia de colateral aplicable a la contraparte o al fondo de pensiones, el cual aparece en el CSA o en otro documento equivalente. Cuando sea un colateral deudor, se registrará la cantidad mínima de la AFP y en caso contrario, el de la contraparte.
10/ Corresponde a la cantidad de redondeo que se toma en consideración para la transferencia de colateral aplicable a la contraparte o al fondo de pensiones, el cual aparece en el CSA o en otro documento equivalente. Cuando sea un colateral deudor, se registrará la cantidad mínima de la AFP y en caso contrario, el de la contraparte.
11/ Corresponde al primer monto de colateral colocado por el fondo de pensiones o favor de este. Expresado en la moneda definida en 5.
12/ Corresponde al colateral colocado o recibido en la fecha de reporte del presente Anexo. Expresado en la moneda definida en 5.
13/ Corresponde a la tasa de interés nominal anual que remunera a la cuenta de colateral.
14/ Corresponde al monto de interés diario de la cuenta de colateral. Expresado en la moneda definida en 5.
15/ Corresponde al monto de interés acumulado de la cuenta colateral. Expresado en la moneda definida en 5.
16/ Corresponde al saldo final de la cuenta de colateral colocado o recibido a la fecha de reporte del presente Anexo. Expresado en la moneda definida en 5.
17/ Corresponde al código de valor, código de emisor, código de la moneda y código referencial del instrumento entregado o recibido como colateral.
18/ Corresponde al número de unidades del instrumento señalado en 18, entregado o recibido como colateral
19/ Corresponde al monto de efectivo colocado o recibido como colateral.