

REGLAMENTO OPERATIVO II.3

INFORMACIÓN PARA DETERMINAR EL DÓLAR OBSERVADO

El presente RO dispone los procedimientos para la entrega de la información de las operaciones de compra/venta *spot* de pesos chilenos contra dólares de los Estados Unidos de América, efectuadas por Entidades del MCF Bancarias y No Bancarias, que es utilizada para el cálculo del tipo de cambio denominado “Dólar Observado”.

De conformidad con el artículo 44 de la LOC y lo establecido en el Capítulo I del Compendio, el BCCh deberá publicar el tipo de cambio de las monedas extranjeras de general aceptación en los mercados internacionales de cambios, en función de las transacciones realizadas en el MCF durante el día hábil inmediatamente anterior y, si es del caso, sobre la base de los informes que pueda obtener de los registros de los mercados del exterior.

Se deben excluir del envío las operaciones donde el tipo de cambio no se negocie ese mismo día a precios de mercado, como las operaciones pactadas al Dólar Observado, incluidas aquellas en que se aplica un *spread* sobre el Dólar Observado, las asociadas al vencimiento de contratos de derivados pactados bajo la modalidad de entrega física y las transacciones correspondientes a los programas de compra/venta de divisas realizadas por el BCCh.

Las entidades del MCF deberán conservar y disponer digitalmente la documentación relacionada con las operaciones de cambios internacionales, y entregarla al BCCh en caso de ser requerida, de acuerdo a lo establecido en el numeral IV del Capítulo I del CNCI.

SISTEMA DE INFORMACIÓN 3.1

ESPECIFICACIONES DE LA INFORMACIÓN REQUERIDA PARA CÁLCULO DEL DÓLAR OBSERVADO

I. INSTRUCCIONES GENERALES:

Las Entidades del MCF Bancarias y No Bancarias, deberán proporcionar información diariamente respecto de las transacciones de compra y venta al contado (*spot*) entre el peso chileno y el Dólar.

Este reporte deberá enviarse antes de las 16:30 horas con las operaciones efectuadas hasta las 16:00 horas del mismo día hábil bancario en que se negoció la operación (*trade date*), la cual normalmente es anterior a la fecha de la valuta, ya que esta última refleja la fecha en que se abonarán o cargarán las cuentas corrientes respectivas lo que se efectúa normalmente entre uno o dos días hábiles después.

Se debe indicar para cada transacción de compra/venta de moneda extranjera los antecedentes detallados en el numeral II de este Sistema de Información.

II. INFORMACIÓN SOLICITADA

No Campo	Nombre	Descripción
1	Rut Reportante	RUT de la entidad obligada a reportar.
2	Fecha y hora de la operación.	Fecha y hora (<i>time stamp</i>) en que la entidad del MCF cerró la Operación de Cambio Internacional (OCI), la que debe registrar en su sistema de información en un tiempo no superior a 15 minutos. Esta fecha es conocida también como " <i>trade date</i> ".
3	Tipo de operación	Código que identifica si la operación corresponde a una compra o venta de Dólares contra Pesos, indicando 1 en caso de compra y 2 para venta.
4	Identificador de la operación	Código único asignado por la entidad del MCF a cada operación de cambios.
5	RUT de la contraparte	Rol Unico Tributario (RUT) que identifica a la contraparte de la entidad obligada a reportar
6	LEI de la contraparte	Código LEI (Legal Entity Identifier) que identifica a la contraparte de la entidad obligada a reportar, si lo tuviere. Este será obligatorio para contrapartes no residentes.
7	Nombre de la contraparte	Nombre o razón social completa de la Contraparte.
8	Plataforma de negociación	Código de la Plataforma de Negociación en la cual fue pactado el contrato, según código MIC (Market Identifier Code) de la norma ISO 10383. En el caso que la transacción fuese negociado de manera telefónica, correo electrónico u otra forma fuera de Bolsa, se deberá indicar en este campo el código "OTC".
9	Monto moneda comprada	Monto de la moneda de origen a recibir por la entidad del MCF desde la Contraparte de la OCI.
10	Monto moneda vendida	Monto de la moneda de origen a entregar por la entidad del MCF a la Contraparte en la OCI.

No Campo	Nombre	Descripción
11	Tipo de cambio de la operación	Corresponde al tipo de cambio al cual se efectúa la OCI, expresado en la convención pesos por una unidad de dólar de los Estados Unidos de América.