

Libro IV, Título VIII Informes Diarios que deben presentar las Administradoras de Fondos de Pensiones

Capítulo II. Informe Diario

El informe diario está compuesto básicamente por un conjunto de datos codificados que deben ser proporcionados a esta entidad Fiscalizadora, a través de los siguientes formularios electrónicos, los que se adjuntan en el Anexo N° 1 de este título:

Formulario D - 1 : Balance Diario, Flujo de Caja, Estado de Variación del Patrimonio y otra información general.

Formulario D - 2.1 : Saldos diarios en cuentas corrientes banco inversiones nacionales.

Formulario D - 2.2 : Movimientos diarios de la cartera y de la custodia de las inversiones del Fondo de Pensiones: Instrumentos financieros transados en el mercado nacional.

Formulario D - 2.3 : Saldos diarios en cuentas corrientes banco inversiones extranjeras.

Formulario D - 2.4 : Movimientos diarios de la cartera y de la custodia de las inversiones del Fondo de Pensiones: Instrumentos financieros transados en mercados extranjeros.

Formulario D - 2.5 : Movimientos diarios de la cartera de inversiones del Fondo de Pensiones: Contratos de opciones, futuros y forwards en el mercado nacional.

Formulario D - 2.6 : Movimientos diarios de la cartera de inversiones del Fondo de Pensiones: Contratos de opciones, futuros y forwards en el extranjero.

Formulario D - 2.7 : Movimientos diarios de la cartera de inversiones del Fondo de Pensiones: Contratos de swaps en el mercado nacional.

Formulario D - 2.8 : Movimientos diarios de la cartera de inversiones del Fondo de Pensiones: Contratos de swaps en el mercado extranjero.

Formulario D - 2.9 : Transacciones de nuevos instrumentos de la cartera de inversiones del Fondo de Pensiones: nuevos instrumentos financieros transados en mercados extranjeros.

Formulario D - 2.10 : Operaciones de cambio de monedas extranjeras.

Formulario D-2.11 : Garantía enterada en efectivo, provisión y cobro de dividendos y otros eventos de capital diarios de la cartera de inversiones del Fondo.

Formulario D-2.12 : Bonos de reconocimiento vencidos por cobrar.

Formulario D-2.13 : Transacciones de nuevos instrumentos de la cartera de inversiones del Fondo de Pensiones: nuevos fondos mutuos y de inversión nacionales y promesas de suscripción de cuotas de fondos de inversión nacionales.

Formulario D-2.14.1 : Excesos de inversión diarios por operaciones con instrumentos derivados.

Formulario D-2.14.2 : Déficit de inversión diarios por operaciones con instrumentos derivados.

Formulario D-2.15 : Corte de Cupón diario de la cartera de inversiones del Fondo.

Formulario D-2.16 : Valoración de operaciones vigentes con instrumentos derivados, que emplean garantías bilaterales

Formulario D-2.17 : Movimiento por Garantías recibidas en efectivo y en instrumentos por operaciones con derivados que empleen garantías bilaterales.

Formulario D-2.18 : Cartera de Garantías recibidas en efectivo y en instrumentos.

Formulario D-2.19: Información referente a adquisición o enajenación de bienes raíces y a nuevos contratos de inversiones del Fondo de Pensiones: Mutuos Hipotecarios, Créditos Sindicados, Leasing y Arrendamiento de Bienes Raíces nacionales.

Formulario D-2.20: Movimientos diarios de la cartera: Acciones de sociedades anónimas cerradas, Acciones de sociedades en comandita por acciones y Acciones de sociedad por acciones.

Formulario D-2.21: Operaciones con mutuos hipotecarios y créditos sindicados.

Formulario D-2.22: Movimientos diarios de la cartera del Fondo de Pensiones: Bienes raíces y Contratos de renta y leasing de bienes raíces.

Formulario D-3.1 : Valores de cuota y Patrimonio.

Nota de actualización: Los formularios D-2.14 y D-2.15 fueron agregados por la Norma de Carácter General N° 98, de fecha 16 de diciembre de 2013. Posteriormente, los antiguos formularios D-2.11 al D-2.15 fueron reenumerados, incorporándose además los nuevos formularios D-2.11, D-2.12, D-2.13 y D-2.15 por la Norma de Carácter General N° 138, de fecha 11 de marzo de 2015. Posteriormente, se modificó el nombre del formulario D-2.15 y se incorporaron los formularios D-2.16 al D-2.18 mediante la norma de carácter general N° 195, de fecha 16 de febrero de 2017. Los formularios D-3.2 y D-3.3 fueron eliminados por la Norma de Carácter General N° 195, de fecha 16 de febrero de 2017. Los formularios D-2.19 al D-2.22 fueron incorporados por la Norma de Carácter General N° 208, de fecha 25 de octubre de 2017.