Descripción de Servicios

DEPOSITO CENTRAL DE VALORES

DCV

Control de Límites para Sistema de Multifondos Previsionales

Versión 6
11, julio 2002

INDICE:

1. Antecedentes 4
2. Propuesta 4
3. Adecuaciones 6
3.1 MODELO DE DATOS 6
3.2 APLICACIONES AFECTADAS 7
3.2.1 Cliente interno (CI) 7
3.2.1.1 MANTENEDOR TABLA CTA_AFECTAS 7
3.2.1.2 LÍNEA DE DEPÓSITO DE CUSTODIA (9141) 7
3.2.2 Custodia (CUS) 7
3.2.2.1 VALIDACIÓN DE REGISTROS (CPAC009) 7
3.2.3 Liquidación (LIQ) 7
3.2.3.1 VERIFICADOR DE POSICIONES, LQAC002 7
3.2.3.2 LIQUIDADOR DE OPERACIONES, LQAC033 7
3.2.3.3 CÁLCULO MARGEN DE OPERACIÓN, LQAC027 7
3.2.4 Cuenta de Inventario (INV) 7
3.2.4.1 VALIDACIÓN DE REGISTROS CUENTA DE INVENTARIO, INVE003 7
3.2.4.2 ACTUALIZADOR DE LÁMINAS EN CUENTA DE INVENTARIO, INVE004 8
3.2.4.3 VERIFICACIÓN DE MÁRGENES DE OPERACIÓN, WINV 8
3.2.5 Registro operaciones APC-Win, Cancelamiento de operaciones WRG3 8
3.2.6 Bonos de reconocimiento afiliados activos (BRA) 8
3.2.6.1 ACTUALIZADOR DE LÁMINAS EN BRAA, INVE006 8
3.2.7 Archivos Entrantes (ARC) 8
3.2.7.1 REGISTROS HEADER Y CONTROL, ARCH104 8
3.2.7.2 VALIDACIÓN ARCHIVOS, TRADUCCION, ARCH111 8
3.2.7.3 CARGA DE REGISTROS, TRADUCCION, ARCH311 8
3.2.7.4 VALIDACIÓN ARCHIVOS, PRECIOS, ARCH112 8
3.2.7.5 CARGA DE REGISTROS, PRECIOS, ARCH312 8
3.2.7.6 VALIDACIÓN DE REGISTROS, PRECIOS, ARCH412 8
3.2.7.7 VALIDACIÓN DE REGISTROS, VALOR REQUERIDO, ARCH410 9
3.2.8 Informes SAFP (SAF) 9
3.2.8.1 INFORME DE POSICIONES, LIST034 Y DE OPERACIONES LIST035 9
3.2.9 Informes (INF) 9
3.2.9.1 INFORME DE POSICIONES, LIST026 9
3.3 TABLAS MODIFICADAS 9
3.3.1.1 SE DEBE MODIFICAR ESTRUCTURA DE TABLA SALINS LA CUAL DEBE

CONSIDERAR COMO NUEVA COLUMNA LA CUENTA DE INVENTARIO. 9
3.3.1.2 SE DEBE CREAR LA TABLA CTA_AFECTAS 9
3.4 INFORMACIÓN ELIMINAR 9
4. Nueva estructura de registros. 9

1. Antecedentes

Durante los primeros veinticuatro meses contados desde Agosto del 2002 el requisito de custodia a que se refiere el artículo 44 del decreto ley N° 3.500, de 1980, corresponde al noventa por ciento de la suma de los patrimonios y sus respectivos encajes de los distintos tipos de Fondos de una misma Administradora.

También a partir del mes de septiembre se deben incorporar las Administradoras de Fondos de Cesantía que operan en forma equivalente a una AFP, debiendo también mantener un monto mínimo en custodia. Estos fondos están bajo la supervisión de la SAFP.

Dada esta coyuntura y dado el actual procedimiento de control de márgenes de operación que el DCV ofrece a los fondos de pensiones, el que considera fondos separados para cada uno de ellos, se hace necesario realizar adecuaciones al Sistema para considerar esta transición.

Por otra parte, los archivos recibidos por la SAFP correspondientes a la custodia mínima requerida y precios son modificados en su estructura, el primero se reemplaza por el envío de sólo un archivo con los valores requeridos en custodia sin indicar un fondo en particular [1]. También, en el archivo de precios se incluye el código mnemotécnico prescindiéndose del archivo de traducción.

2. Propuesta

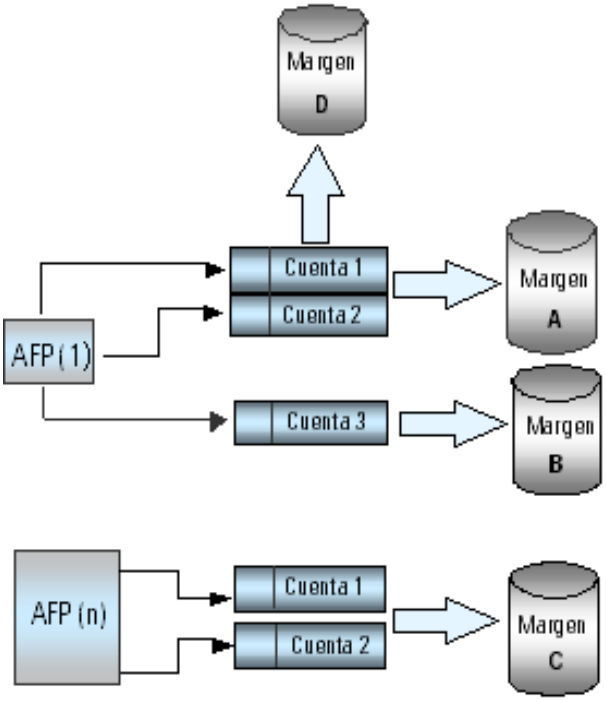
Se propone dar la capacidad al sistema de controlar márgenes de operación en forma totalmente flexible, de manera que se pueda manejar la figura de que varios fondos de pensiones estén afectos a un margen común y también que un fondo funcione en forma independiente.

Para lograr dicha situación se relacionan las cuentas que los fondos de pensiones mantienen en el DCV con él o los límites a que estén afectas.

El siguiente esquema representa la relación que se implementa para llevar el control deseado.

[1] Cabe destacar que se envió un archivo para los Fondos de Pensiones y otro para el Fondo de Cesantía.

Figura 1

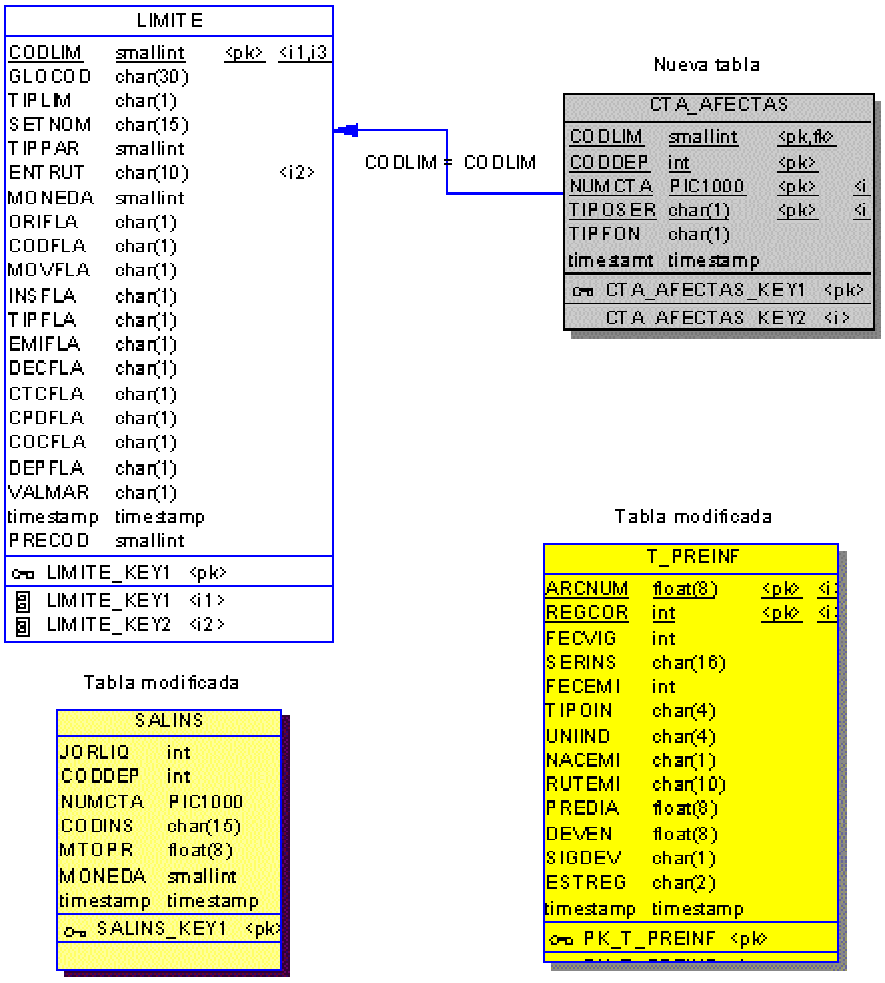

Margen
D
Cuenta 1
Cuenta 2
Margen
A
AFP (1)
Cuenta 3
Margen
B
AFP (n)
Cuenta 1
Cuenta 2
Margen
C

3. Adecuaciones

Las modificaciones que se requieren para dotar al sistema DCV de tal característica, son las siguientes:

3.1 MODELO DE DATOS

La estructura de datos a utilizar para determinar las cuentas afectas control de límite es la siguiente:



Se agrega la tabla CTA_AFECTA que indica a que control de límite está afecta una determinada cuenta. Para esto, las aplicaciones encargadas de realizar los controles deben consultar por NUMCTA Y TIPOSER (P:Posición ó I:Inventario).
A la tabla SALINS de cuenta de inventario se le agrega el número de la cuenta de inventario.

3.2 APLICACIONES AFECTADAS

De acuerdo a la propuesta y a los cambios que tienen los archivos recibidos por la SAFP, se debe considerar la siguiente lista de aplicaciones a ser modificadas.

3.2.1 Cliente interno (CI)

3.2.1.1 MANTENEDOR TABLA CTA_AFECTAS

3.2.1.2 LÍNEA DE DEPÓSITO DE CUSTODIA (9141)

Eliminar la creación de precios para emisiones de IIF.

3.2.2 Custodia (CUS)

3.2.2.1 VALIDACIÓN DE REGISTROS (CPAC009)

Eliminar la creación de precios para emisiones de IIF.

3.2.3 Liquidación (LIQ)

Todas estas aplicaciones deben ser certificadas por Calidad de Software.

3.2.3.1 VERIFICADOR DE POSICIONES, LQAC002

Se debe adecuar aplicación para que considere los campos CODDEP y CODLIM de tabla LIMITE, de tal forma de aplicar el control de margen sobre el depositante y fondo registrado en estos campos.

Además para instrumentos de Intermediación Financiera se inserta el precio en tabla PRECIOS y PREINF indicando valor 0.8, además se utiliza este valor para calcular el monto de la posición transada.

3.2.3.2 LIQUIDADOR DE OPERACIONES, LQAC033

Se debe adecuar aplicación para que considere los campos CODDEP y CODLIM de tabla LIMITE, de tal forma de aplicar el control de margen sobre el depositante y fondo registrado en estos campos.

3.2.3.3 CÁLCULO MARGEN DE OPERACIÓN, LQAC027

Se debe adecuar aplicación para que considere los campos CODDEP y CODLIM de tabla LIMITE, de tal forma de registrar la cartera calculada en el depositante y fondo registrado en estos campos.

3.2.4 Cuenta de Inventario (INV)

Todas estas aplicaciones deben ser certificadas por Calidad de Software

3.2.4.1 VALIDACIÓN DE REGISTROS CUENTA DE INVENTARIO, INVE003

Se debe adecuar aplicación para que considere los campos CODDEP y CODLIM de tabla LIMITE, de tal forma de registrar la cartera calculada en el depositante y fondo registrado en estos campos.

3.2.4.2 ACTUALIZADOR DE LÁMINAS EN CUENTA DE INVENTARIO, INVE004

Se debe adecuar aplicación para que considere los campos CODDEP y CODLIM de tabla LIMITE, de tal forma de registrar la cartera calculada en el depositante y fondo registrado en estos campos.

3.2.4.3 VERIFICACIÓN DE MÁRGENES DE OPERACIÓN, WINV

Se debe adecuar el procedimiento almacenado ***Sp_vere_val_cinv*** que verifica los márgenes de operación cuando la cuenta de inventario controla límites.

3.2.5 Registro operaciones APC-Win, Cancelamiento de operaciones WRG3

Estas aplicación debe ser certificada por Calidad de Sotware.

Se debe adecuar transacción TX1022, para el proceso de cancelamiento de operaciones de tal forma de actualizar márgenes de operación considerando los campos CODDEP Y CODLIM de tabla LIMITE.

3.2.6 Bonos de reconocimiento afiliados activos (BRA)

Estas aplicación debe ser certificada por Calidad de Software.

3.2.6.1 ACTUALIZADOR DE LÁMINAS EN BRAA, INVE006

Se debe adecuar aplicación para que considere los campos CODDEP y CODLIM de tabla LIMITE, de tal forma de registrar la cartera calculada en el depositante y fondo registrado en estos campos.

3.2.7 Archivos Entrantes (ARC)

Todas estas aplicaciones deben ser certificadas por Calidad de Software.

3.2.7.1 REGISTROS HEADER Y CONTROL, ARCH104

Se modifica la aplicación para que considere los nuevos formatos de archivos recibidos.
Para el caso del archivo margen para fondos de pensión y cesantía se registrará en duro el código del fondo, de esta forma no son necesario modificar los programas que realizan la carga de la custodia requerida, que son ARCH110, ARCH310 y ARCH410.

3.2.7.2 VALIDACIÓN ARCHIVOS, TRADUCCION, ARCH111

Aplicación debe ser eliminada.

3.2.7.3 CARGA DE REGISTROS, TRADUCCION, ARCH311

Aplicación debe ser eliminada.

3.2.7.4 VALIDACIÓN ARCHIVOS, PRECIOS, ARCH112

Adecuar aplicación a nuevo formato de archivo recibido.

3.2.7.5 CARGA DE REGISTROS, PRECIOS, ARCH312

Adecuar aplicación a nuevo formato de archivo recibido.

3.2.7.6 VALIDACIÓN DE REGISTROS, PRECIOS, ARCH412

Adecuar aplicación a nuevo formato de archivo recibido, además se debe inhibir la búsqueda del mnemotécnico en el diccionario ya que el campo viene informado en el nuevo formato.

3.2.7.7 VALIDACIÓN DE REGISTROS, VALOR REQUERIDO, ARCH410

Adecuar aplicación a la nueva estructura que determina los depositantes afectos al control margen.

3.2.8 Informes SAFP (SAF)

3.2.8.1 INFORME DE POSICIONES, LIST034 Y DE OPERACIONES LIST035

En ambos informes se debe inhibir la búsqueda del mnemotécnico en el diccionario ya que este archivo no es informado.

Por otra parte se está a la espera de que con la Superintendencia responda a la consulta si es necesario informar en estos archivos el tipo de instrumento detallado en el archivo de precios, si así fuera se deberá mantener guardar este campo en alguna tabla para volver a informarlo.

3.2.9 Informes (INF)

3.2.9.1 INFORME DE POSICIONES, LIST026

Se debe adecuar aplicación para que considere la búsqueda de cuentas afectas a margen según estas nuevas definiciones.

3.3 TABLAS MODIFICADAS

3.3.1.1 SE DEBE MODIFICAR ESTRUCTURA DE TABLA SALINS LA CUAL DEBE CONSIDERAR COMO NUEVA COLUMNA LA CUENTA DE INVENTARIO.

Nuevo columna	Descripción
NUMCTA	Cuenta de inventario

3.3.1.2 SE DEBE CREAR LA TABLA CTA_AFECTAS

3.4 INFORMACIÓN ELIMINAR

Como el Diccionario no es informado por la SAFP se debe eliminar el registro de este proceso desde tablas ARCPRG y ARCCAT, cuyo código de proceso corresponde a CLI_TRADUCC.

4. Nueva estructura de registros.

La nuevos formatos de archivos de intercambios están definidos en el documento “NTransmisión DCV1.doc”.