

REF.: Modifica Circular N° 1835, que imparte instrucciones relativas a la forma y contenido de información sobre inversiones y del sistema de evaluación del riesgo de mercado de cartera de inversiones.

CIRCULAR N° 2239

Para todas las entidades de seguros y reaseguros

22 de noviembre de 2018

Esta Comisión, en uso de sus facultades legales que le confieren el numeral 3 del artículo 20, del Decreto Ley N° 3.538 conforme al texto reemplazado por el artículo primero de la Ley N° 21.000 que crea la Comisión para el Mercado Financiero, y lo acordado por el Consejo de la Comisión en sesión ordinaria de 22 de noviembre de 2018, ha estimado necesario modificar la Circular N° 1835 de 2007, en los términos siguientes:

1. Elimínese del Título de la referencia, el siguiente texto:

“y del sistema de evaluación del riesgo de mercado de cartera de inversiones”
2. Elimínese del primer párrafo el siguiente texto:

“y sobre el sistema de evaluación del riesgo de mercado, VaR,”
3. Elimínese del Título I el siguiente texto:

“Y VAR”
4. Elimínese del Título I, el número 4, pasando a ser los números 5 y 6, los números 4 y 5 respectivamente.
5. Elimínese del Título I, ANEXOS, los anexos N°2, N°3 y N°4.
6. Elimínese del Título I los párrafos siguientes:

“Adicionalmente, las compañías deberán entregar información relacionada a la efectividad del programa de VaR en predecir las máximas pérdidas de los activos sujetos a la medición, ingresando para ello una nota explicativa de las diferencias encontradas entre el VaR proyectado y el obtenido de la cartera sujeta a VaR. Tanto el stress testing como el back testing se encuentran definidos en el punto N° 5 del Título III de la Norma de Carácter General N° 148, del 9 de octubre de 2002.

Av. Libertador Bernardo
O'Higgins 1449, Piso 1°
Santiago - Chile
Fono: (56 2) 2617 4000
Casilla 2167 - Correo 21
www.cmfchile.cl



La información de los Anexos N° 2, 3 y 4 deberá ser ingresada mediante formulario interactivo al momento de enviar el resto de los archivos vía SEIL.”

7. Elimínese en el Título I del INDICE la expresión “Y VAR”.
8. Elimínese del INDICE, Título I, SECCION B, el subtítulo “REGISTROS DE VAR” que comprende las letras B.12, B.13, B.14, B.15 y B.16.
9. Elimínense del INDICE, Título II ANEXOS, los ANEXOS N°2, 3 y 4.
10. Elimínese de la SECCIÓN A: Instrucciones para el Envío Mediante Internet, del punto A.5 INDIVIDUALIZACION DE LOS ARCHIVOS, los archivos B.12, B.13, B.14, B.15 y B.16.
11. Elimínese de la SECCION B Estructura de los Registros de la Circular, los registros B.12, B.13, B.14, B.15 y B.16.
12. Elimínense los ANEXOS N°2, 3 Y 4.-

Vigencia: La presente norma rige a contar del 31 de enero de 2019.

COMISION PARA EL MERCADO FINANCIERO

Transcribo el texto de la presente normativa aprobada mediante Resolución Exenta N°5268 de 22-11-2018

GERARDO BRAVO RIQUELME
SECRETARIO GENERAL

