

CIRCULAR N° 2.277**Bancos**

Santiago, 02 de noviembre de 2020

Sistema integrado de información sobre transacciones de derivados del Banco Central de Chile. Control de la calidad de la información y resguardos operacionales.

Conforme a lo dispuesto en el Acuerdo N°2236-01-190711, de 11 de julio de 2019, el Consejo del Banco Central de Chile incorporó al Compendio de Normas Financieras, el Capítulo III.D.3, denominado “Sistema Integrado de Información sobre Transacciones de Derivados” (SIID), mediante el cual se establecen las disposiciones que rigen el repositorio de transacciones de derivados negociados *Over the Counter* (OTC) que es administrado por dicho Instituto Emisor, acorde a las mejores prácticas internacionales y con adhesión a los Principios aplicables a las Infraestructuras del Mercado Financiero (PFMI por sus en inglés).

Entre las entidades obligadas a proporcionar información a dicho repositorio (Participantes) se encuentran las empresas bancarias, incluidas dentro de dicha clasificación, las filiales a las que se refiere el artículo 70 letra a) de la Ley General de Bancos. En dicho marco, las empresas bancarias constituyen la principal fuente de información del repositorio, debiendo reportar todos los tipos de contratos que contempla la normativa (cambiaros y no cambiaros), de forma diaria y mensualmente en el caso de los bancos matrices, y mensualmente respecto de las referidas filiales.

En atención a que las citadas normas comienzan a regir a contar del próximo 3 de noviembre, según lo previsto en las disposiciones transitorias del Capítulo III.D.3., esta Comisión considera pertinente impartir las siguientes instrucciones a los bancos en materia de responsabilidad y diligencia para la preparación, envío y control de calidad de dicha información, tanto propia como de sus filiales:

1. Control de la calidad de la información

Dada la naturaleza del repositorio y la responsabilidad que le cabe a las empresas bancarias respecto a la calidad de la información que reporten al SIID, deberán adoptar los siguientes resguardos:

- a) La función de auditoría interna deberá revisar anualmente el proceso de calidad de la información que corresponda remitir al SIID, incluida aquellas emanada de sus filiales. Tal revisión deberá quedar plasmada en un reporte anual, que habrá de ser remitido a esta Comisión durante el mes de julio de cada año, que dé cuenta de los resultados que se originen de las revisiones realizadas por dicha función, en los mismos términos a los que se refiere la Carta Circular N°1 Bancos, de 6 de marzo de 2012.
- b) La información enviada deberá ser identificada como un activo crítico, y el nivel de atención a la misma debe ser suficiente para la gestión de sus riesgos asociados, considerando lo dispuesto en el Capítulo 20-10 de la Recopilación Actualizada de Normas, en materia de seguridad de la información y ciberseguridad.
- c) Los incidentes operacionales que afecten la preparación y envío de antecedentes al SIID deberán ser informados a través de Sistema de Reporte de Incidentes Operacionales (RIO), independientemente de las instrucciones que pueda impartir el Banco Central de Chile en su calidad de administrador del repositorio.

2. Responsabilidad del envío de la información de las filiales

En concordancia con lo dispuesto en el inciso segundo de la letra a) del artículo 70 de la Ley General de Bancos, dada la importancia que pueden llegar a representar las operaciones de las filiales a que se refiere dicho precepto, para la situación financiera de un banco, y que por lo demás, éstas se consideran incluidas dentro de la definición de empresas bancarias que contiene el Capítulo III.D.3, cada entidad matriz será responsable de identificar y asegurar el correcto envío de la información requerida por el Banco Central de Chile respecto de aquellas filiales que registren operaciones que correspondan ser reportadas. Para dicho fin, los bancos matrices podrán prestar

servicios de procesamiento de datos de acuerdo a lo dispuesto en el Capítulo 11-6 de la Recopilación Actualizada de Normas, pudiendo enviar directamente dicha información para efectos del citado Capítulo III.D.3 y su Reglamento Operativo.

3. Disposiciones transitorias

Los bancos deberán informar a la Comisión, a más tardar el 12 de noviembre de 2020, las filiales respecto de las cuales el banco matriz deba asegurar el correcto envío de la información al SIID. Dicha comunicación deberá ser enviada cada vez que corresponda reportar información de una nueva filial.

Por su parte, tratándose del informe a que se refiere la letra a) del N°1 de estas instrucciones, excepcionalmente se deberá remitir durante el mes de abril de 2021 un informe provisorio al 31 de marzo de 2021, dando cuenta del trabajo realizado a esa fecha, junto a eventuales deficiencias detectadas y las medidas adoptadas para abordarlas.



Joaquín Cortez Huerta
Presidente
Comisión para el Mercado Financiero

ID: 346611



0 000000 759519