

# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

## CIRCULAR No. 023 -2011-BCRP

### Información sobre operaciones con productos financieros derivados de tasas de interés y otros

#### CONSIDERANDO:

Que el Directorio de este Banco Central, en uso de las facultades que le son atribuidas en los Artículos 4 y 74 de su Ley Orgánica, ha resuelto solicitar información relacionada con las operaciones con instrumentos derivados de tasas de interés y otros realizados por las entidades del sistema financiero (ESF) .

#### SE RESUELVE:

##### Artículo 1. Ámbito de aplicación

Las ESF obligadas a reportar la información requerida en la presente Circular son las siguientes:

- a. Las empresas de operaciones múltiples señaladas en el Artículo 16 de la Ley N° 26702, que se encuentren autorizadas a captar depósitos del público.
- b. Banco de la Nación.
- c. Corporación Financiera de Desarrollo (COFIDE).

##### Artículo 2. Información inicial

A partir del 1 de agosto de 2011, las ESF deberán remitir al Banco Central una copia del Anexo N° 8 "Posiciones en instrumentos financieros derivados" definido por la Superintendencia de Banca Seguros y AFP (SBS), o el que lo reemplace. Para tal efecto, se incluirá el nombre de la contraparte solo cuando se trate de una operación con otra ESF.

##### Artículo 3. Información adicional

A partir del 1 de marzo de 2012, en forma adicional al envío del Anexo N° 8 de la SBS, las ESF deberán presentar al Banco Central la información de acuerdo con los formularios, indicaciones y especificaciones técnicas publicados en su portal institucional: <http://www.bcrp.gob.pe>. Dichos reportes consisten en:

- a. Operaciones pactadas, modificadas, ejercidas y anuladas durante el día, por cada tipo de instrumento.
- b. Saldos por cada tipo de instrumento.

##### Artículo 4. Frecuencia y medio de envío de los reportes

La información señalada en los Artículos 2 y 3 deberá ser enviada con frecuencia semanal, en los días 7, 15, 22 y último día de cada mes. La hora límite para la entrega de dicha información será las 15:00 horas del día hábil siguiente y se usará como canal de transmisión el Sistema de Interconexión Bancaria – File Transfer Protocol (SIB/FTP).

# **BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ**

De no contarse con este medio, la información deberá ser remitida por correo electrónico al Departamento de Operaciones Monetarias y Cambiarias (Dpto.OpeMonetariasCambiarias@bcpr.gob.pe) o por otro medio que autorice el Banco Central. La lista de otros medios autorizados será publicada en el portal institucional del Banco Central.

## **Artículo 5. Funcionario de enlace**

Cada ESF deberá informar al Banco Central el nombre de un funcionario de enlace y su suplente, quienes serán los responsables de absolver las consultas sobre la información remitida. La designación del funcionario y su suplente deberá ser comunicada por escrito a la Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera del Banco Central al número de facsímil 613-2534, a más tardar una semana después de publicarse la presente circular. Asimismo, deberá informarse al mismo número de facsímil en cada oportunidad que se produzca un cambio de funcionario de enlace.

## **Artículo 6. Modificación de formularios**

Los cambios que requieran aplicarse en los formularios, como consecuencia de la negociación de otros productos derivados no contemplados en la presente norma, serán coordinados con el funcionario de enlace y publicados oportunamente en el portal institucional del Banco Central. Por cada modificación, el Banco Central podrá conceder un periodo apropiado de adecuación para la presentación de los nuevos reportes.

## **Artículo 7. Vigencia**

La presente Circular entra en vigencia a partir del día de su publicación en el diario oficial El Peruano.

Lima, 25 de Julio de 2011

**Marylin Choy Chong**  
**Gerente General (i)**