



EDEVAL

CENTRAL DE DEPÓSITO DE VALORES

www.cedeval.com



PRINCIPIOS BIS-IOSCO

EVALUACIÓN Y CUMPLIMIENTO



INTRODUCCIÓN

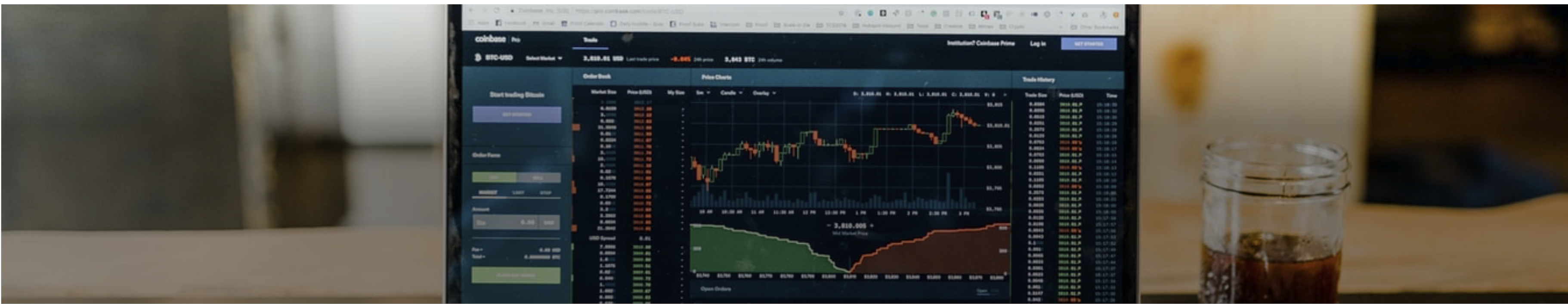
En abril de 2012, el Banco de Pagos Internacionales (BIS, por sus siglas en inglés) y la Organización Internacional de Comisiones de Valores (OICV-IOSCO) presentaron el resultado de una revisión y una actualización a las normas establecidas para las Infraestructuras de los Mercados Financieros (FMI) que permiten la compensación, liquidación, y el registro de operaciones monetarias, y otras operaciones financieras, a fin de fortalecer los mercados en las que participan.

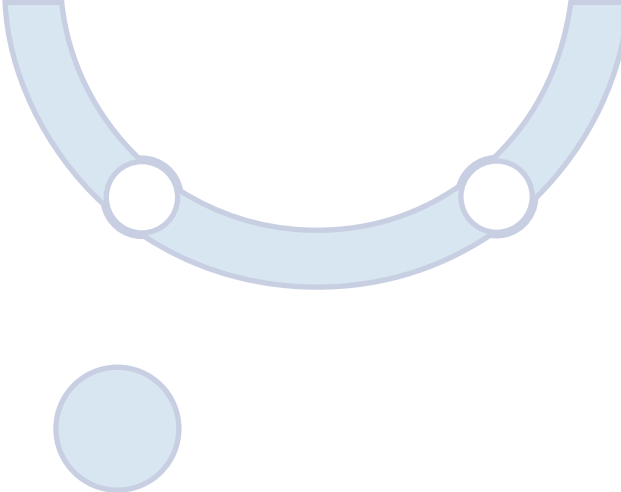
El resultado de la revisión es el establecimiento de 24 principios, aplicables a los diferentes tipos de FMI, según su rol. Éstos principios son aplicables a las FMI gestionadas por los bancos centrales, así como a aquellas FMI del sector privado.

Fuente: Elaboración propia en base a publicación de BIS-IOSCO disponible en https://www.bis.org/cpmi/publ/d101_es.pdf

PROYECTO

Como miembro de ACSDA, CEDEVAL participó en el proyecto para la evaluación, adopción y cumplimiento de los principios, que se desarrolló en las siguientes etapas:





MAY 17

PFMI –
Talleres de
Formación
Básica.

JUL 17 -
ENE 18

Autoevaluación:
completar
autoevaluación
de principios
aplicables a
CEDEVAL

ENE 18

Revisión en sitio
de la
autoevaluación
con
consultores

FEB –
SEP 18

Elaboración y
revisión de
reportes: Anexo A
y B por consulto-
res asignados.
Definición de Plan
de Remediación

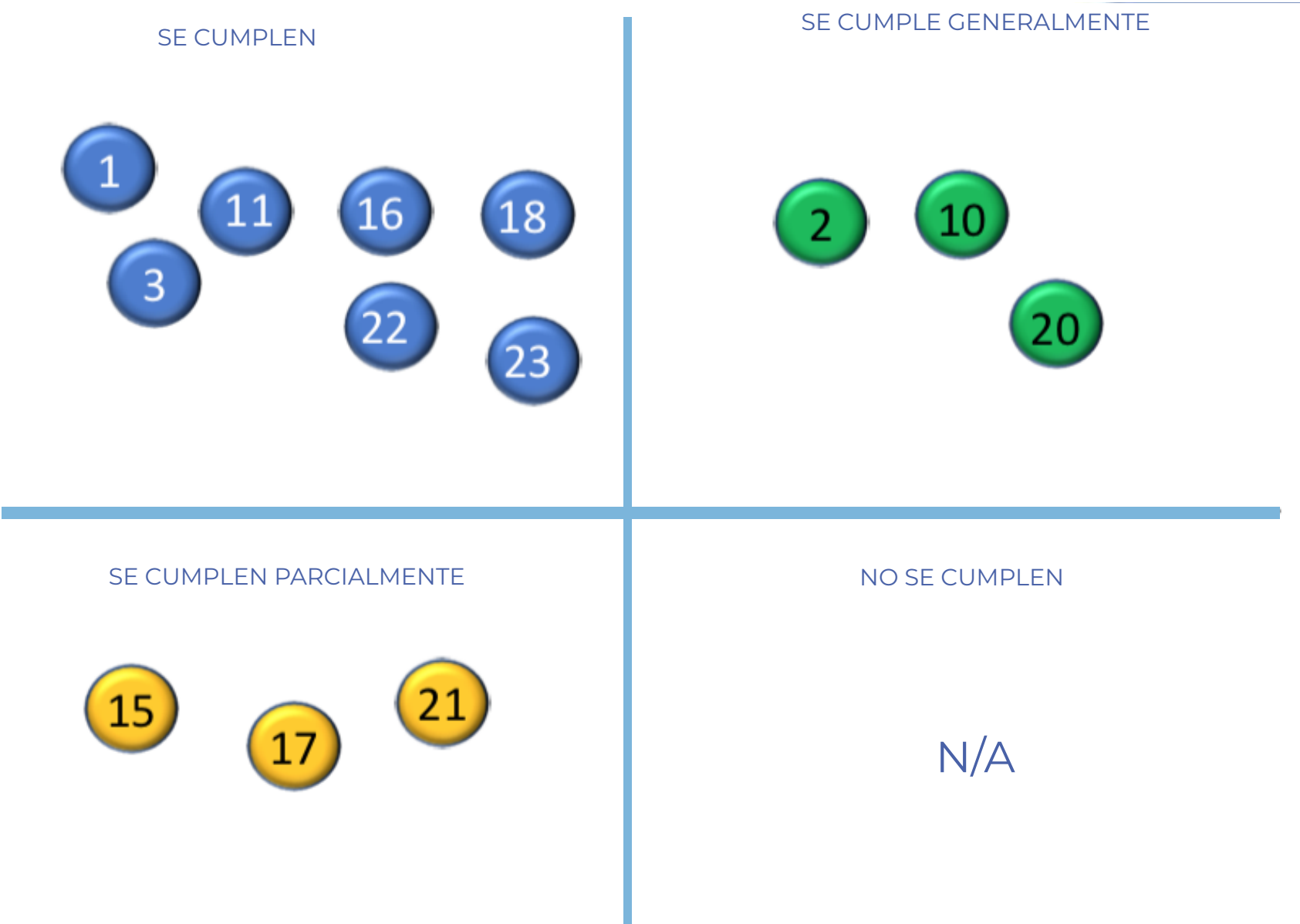
SEP 18

Reportes
finales



Los principios evaluados, aplicables a CEDEVAL, y su resultado, son:

- P1 – Base legal
- P2 – Buen gobierno
- P3 – Marco para la gestión integral de riesgos
- P10 – Entregas físicas
- P11 – Depósitos centrales de valores
- P15 – Riesgo general del negocio
- P16 – Riesgo de custodia e inversión
- P17 – Riesgo operacional
- P18 – Requisitos de acceso y participación
- P20 – Enlaces con otras FMIs
- P21 – Eficiencia y eficacia
- P22 – Normas y procedimientos de comunicación
- P23 – Divulgación de reglas, procedimientos y datos de mercado



SE CUMPLE	SE CUMPLE GENERALMENTE	SE CUMPLE PARCIALMENTE
23. Documentar procedimiento de consulta a participantes ante la emisión y modificación de reglas y procedimientos.	2. Evaluar la factibilidad de implementar de proceso de evaluación de desempeño de JD 10. Revisión de proceso de títulos físicos (NCTPs y Acciones), y evaluar la propuesta de cambios para evitar re-movilización. 20. Establecer y documentar proceso de contratación con otros depositarios.	15. Documentar planes de recuperación financiera ordenada y liquidación ordenada. 17. -Definición de mecanismos de fiabilidad operativa -Documentar proceso para reconstruir información de un día de operaciones a partir del último respaldo. -Evaluar la creación de grupo de trabajo para BCP/DRP con los participantes 21. -Evaluar la definición de BSC por área

