

**CIRCULAR**  
**C-SIMV-2019-13-MV**

**REFERENCIA:** Circular que establece la fecha para la remisión de los índices, indicadores y reportes del Instructivo de Aplicación de la Norma sobre Gestión de Riesgo de Liquidez de Financiamiento de los Intermediarios de Valores aprobado mediante Circular C-SIMV-2019-11-MV de fecha cinco (5) de diciembre del año dos mil diecinueve (2019).

**VISTA** : La Ley núm. 249-17 del Mercado de Valores, de fecha diecinueve (19) de diciembre del año dos mil diecisiete (2017), en particular:

El artículo 17, numeral 14) el cual faculta a la Superintendencia del Mercado de Valores a “*dictar las resoluciones, circulares e instructivos requeridos para el desarrollo de esta ley y sus reglamentos*”.

**VISTA** : La Norma sobre Gestión de Riesgo de Liquidez de Financiamiento de los Intermediarios de Valores, R-CNV-2017-46-IV, emitida mediante la Tercera Resolución del Consejo Nacional de Valores de fecha dieciocho (18) de diciembre del dos mil diecisiete (2017).

**VISTA** : La Circular que aprueba el Instructivo de Aplicación de la Norma sobre Gestión de Riesgo de Liquidez de Financiamiento de los Intermediarios de Valores, C-SIMV-2019-11-MV, de fecha cinco (5) de diciembre del dos mil diecinueve (2019) (en lo adelante, el “Instructivo” o por su propia denominación).

**CONSIDERANDO** : Que el artículo 37 de la Norma sobre Gestión de Riesgo de Liquidez de Financiamiento de los Intermediarios de Valores establece que los intermediarios de valores deberán remitir a la Superintendencia, con la frecuencia requerida por esta, las informaciones requeridas mediante dicha norma.

**CONSIDERANDO** : Que mediante el Instructivo de Aplicación de la Norma sobre Gestión de Riesgo de Liquidez de Financiamiento de los Intermediarios de Valores se establecieron las indicaciones técnicas para la aplicación de los índices, indicadores y reportes de la Norma sobre Gestión de Riesgos de Liquidez de Financiamiento de los Intermediarios de Valores, los cuales deberán ser remitidos periódicamente a esta Superintendencia.

**CONSIDERANDO :** Que el numeral III de la Circular que aprueba el Instructivo de Aplicación de la Norma sobre Gestión de Riesgo de Liquidez de Financiamiento de los Intermediarios de Valores, C-SIMV-2019-11-MV, dispone que los índices, indicadores y reportes de la Norma Sobre Gestión de Riesgos de Liquidez de Financiamiento de los Intermediarios de Valores deberán ser remitidos vía correo electrónico a la siguiente dirección: [reportesriesgo@simv.gob.do](mailto:reportesriesgo@simv.gob.do) hasta tanto no esté funcionando el Sistema Electrónico de Remisión de Información (SERI).

**CONSIDERANDO :** Que si bien se encuentra establecido el contenido y el mecanismo para la remisión de los índices, indicadores y reportes de la Norma Sobre Gestión de Riesgos de Liquidez de Financiamiento de los Intermediarios de Valores, resulta necesario establecer las especificaciones en cuanto a la periodicidad de la remisión dichas informaciones.

La Superintendencia del Mercado de Valores, en el uso de las facultades que le confiere el artículo 17, numeral 14 de la Ley núm. 249-17 del Mercado de Valores, dispone lo siguiente:

- I. Reiterar a los intermediarios de valores que cumplen con las condiciones del artículo 2 del Instructivo de Aplicación de la Norma sobre Gestión de Riesgo de Liquidez de Financiamiento de los Intermediarios de Valores, R-CNV-2017-46-IV, tendrán la obligación de realizar el envío de:
  - 1) La estimación del valor de las reservas de Activos Líquidos de Alta Calidad, conforme lo dispuesto en el artículo 6 del Instructivo.
  - 2) El resultado del ejercicio en la Tabla 7 del instructivo con la estimación de la Salida Neta de Liquidez Esperada a treinta (30) días calendario, conforme lo dispuesto en el artículo 7 del Instructivo.
  - 3) El reporte de Control de Actividades de Financiación por medio del *Sell-Buy-Back*, Repo y sus equivalentes (R-RL02), conforme lo dispuesto en el artículo 8 del Instructivo.
  - 4) El reporte Auxiliar Posiciones Operaciones de Venta Spot con Compra a Plazo (SBB), Compra Spot y Venta a Plazo (RSBB) y equivalentes Vigentes, Préstamos de Valores (R-RL03/04), conforme lo dispuesto en el artículo 8 del Instructivo.

G.C

- II. Informar a los intermediarios de valores que deberán remitir a la Superintendencia del Mercado de Valores cada uno de los reportes citados en el numeral anterior, semanalmente a más tardar el día martes a las doce del mediodía (12:00 p.m.), al cierre del día anterior.
- III. Reiterar a los intermediarios de valores que hasta tanto no esté funcionando el Sistema Electrónico de Remisión de Información (SERI), como disposición transitoria, la remisión de información establecida en la presente Circular deberá ser remitida vía correo electrónico a la siguiente dirección: “[reportesriesgo@simv.gob.do](mailto:reportesriesgo@simv.gob.do)”.
- IV. Informar a los intermediarios de valores que infrinjan las disposiciones contenidas en la presente Circular, serán pasible de las sanciones administrativas contempladas en la Ley núm. 249-17 del Mercado de Valores, de fecha diecinueve (19) de diciembre del año dos mil diecisiete (2017).
- V. Informar a los intermediarios de valores y al público en general que las disposiciones de la presente Circular entrarán a partir de su publicación.
- VI. Instruir a la Dirección de Servicios Legales de esta Superintendencia del Mercado de Valores a publicar el contenido de la presente Circular en la página web de la institución.

En Santo Domingo, Distrito Nacional, capital de la República Dominicana, a los treinta (30) días del mes de diciembre del año dos mil diecinueve (2019).

  
**Gabriel Castro**  
Superintendente

