



Superintendencia del Mercado de Valores  
de la República Dominicana

## CARTA CIRCULAR

Núm. 01/23

- A:** Participantes del Mercado de Valores.
- Asunto:** Avances en la implementación de la Base de Datos de Eventos de Pérdida por Riesgo Operacional (BDEP).
- Anexo:** Formato de Base de Datos de Eventos de Pérdida consolidada por tipo de Riesgo Operacional.

El Superintendente del Mercado de Valores, en el uso de las facultades que le concede el artículo 17 de la Ley núm. 249-17, del Mercado de Valores, dispone lo siguiente:

- I.** Requerir a los intermediarios de valores que, en atención a lo dispuesto en el Título V, Capítulo II, del Reglamento sobre Gestión Integral de Riesgos para los Intermediarios de Valores aprobado mediante la Tercera Resolución R-CNMV-2020-08-MV del Consejo Nacional del Mercado de Valores, de fecha tres (03) de noviembre de dos mil veinte (2020), (en lo adelante, el “Reglamento”), deben remitir lo siguiente:
1. Estatus del avance en la implementación de los lineamientos concernientes al Título V, Capítulo II, artículos 82 al 85 del Reglamento, abordando dentro del documento como mínimo:
    - a. Factores de riesgo operacional;
    - b. Eventos de pérdida por riesgo operacional;
    - c. Responsabilidad del Consejo de Administración;
    - d. Lineamientos metodológicos.
  2. Relación trimestral consolidada de la Base de Datos de Eventos de Pérdida por Riesgo Operacional, según la tipología estipulada en el artículo 83 del Reglamento sobre Gestión Integral de Riesgos. Este archivo debe abarcar el período comprendido entre los meses de enero de dos mil veintiuno (2021), a marzo de dos mil veintitrés (2023), y contemplará los campos señalados en el anexo de la presente Carta Circular.
  3. En caso de no cumplir con los requerimientos señalados en los numerales 1 y 2 de la presente Carta Circular, deben presentar un plan de adecuación con el

*lw*

objetivo de acogerse al Título V del Reglamento sobre Gestión Integral de Riesgos, haciendo especial énfasis en el artículo 86, sobre la Base de Datos de Eventos de Pérdida.

- II. Otorgar a los intermediarios de valores un plazo no mayor a diez (10) días hábiles, contados a partir de la fecha de la publicación de la presente Carta Circular para realizar la entrega de los requerimientos solicitados.
- III. Recomendar a los demás Participantes del Mercado de Valores a que implementen la Base de Datos de Eventos de Pérdida por Riesgo Operacional (BDEP), con el fin de registrar la información mínima por cada pérdida y agrupar la información por el evento que la originó.
- IV. Informar que el equipo técnico de la Superintendencia del Mercado de Valores convocará reuniones con los Participantes del Mercado de Valores, con el fin de atender preguntas e inquietudes sobre la BDEP y la gestión de riesgo operacional.
- V. Instruir a la Dirección de Regulación e Innovación de esta Superintendencia del Mercado de Valores a publicar la presente Carta Circular en la página Web de esta institución.

En Santo Domingo, Distrito Nacional, capital de la República Dominicana, a los treinta (31) días del mes de marzo del dos mil veintitrés (2023).



**Ernesto Bournigal Read**  
Superintendente



*pm/ra/rf/rg/ac*  
EBR/ecb/pm/ra/rf/rg/ac  
Dirección de Regulación e Innovación

**Anexo I.**  
**Base de Datos de Eventos de Pérdida consolidada por tipo de riesgo operacional**

<b>Período<sup>1</sup></b>	<b>Tipo de Evento de Pérdida<sup>2</sup></b>	<b>Cantidad de eventos</b>	<b>Montos brutos de las pérdidas (expresado en DOP)</b>	<b>Montos recuperados mediante coberturas existentes de forma previa al evento (expresado en DOP)</b>	<b>Monto total recuperado (expresado en DOP)</b>
2021-T01					
2021-T02					
2021-T03					
2021-T04					
2022-T01					
...					
...					
...					
...					
2023-T01					

<sup>1</sup> El período será expresado por trimestres, consolidado de acuerdo a la fecha de ocurrencia o inicio del evento.

<sup>2</sup> La tipificación de los eventos de pérdida debe realizarse conforme a la Tabla I: Tipo de Eventos de Pérdida por Riesgo Operacional ubicada en los anexos del Reglamento sobre Gestión Integral de Riesgos para los Intermediarios de Valores (R-CNMV-2020-08-MV).