



PERÚ

Ministerio
de Economía y Finanzas

SMV
Superintendencia del Mercado
de Valores

Nota de Prensa N° 03 – 2023 SMV

SMV actualiza el Reglamento de Gestión Integral de Riesgos incorporando los resultados de las actividades de supervisión y mejores prácticas internacionales

- **El nuevo Reglamento de Gestión Integral de Riesgos publicado el 19 de Enero de 2023 actualiza las definiciones de los riesgos que enfrentan las entidades del mercado de valores y mejora la aplicación de la primera norma de gestión de riesgos que emitió la SMV en el año 2015**

El Directorio de la Superintendencia del Mercado de Valores (SMV) aprobó mediante la Resolución N° 001-2023-SMV/01 el nuevo Reglamento de Gestión Integral de Riesgos (GIR), el cual estuvo en consulta ciudadana hasta el 10 de octubre del 2022. La matriz de los comentarios recibidos y las respuestas de la SMV a estos, se pueden encontrar en el portal de internet de esta Superintendencia.

El Reglamento GIR actualiza, de acuerdo con estándares internacionales y regulación financiera local emitidas en los últimos años, las definiciones de los diversos tipos de riesgos que enfrentan las Entidades que operan en el mercado de valores peruano; así como contextualiza la aplicación de la primera norma de gestión de riesgos emitida por la SMV en el 2015 (Resolución SMV N° 037-2015-SMV/01), como resultado de las acciones de supervisión y de las consultas realizadas por las entidades en los últimos años (revisar video instructivo).

Los principales cambios a la norma considerando los comentarios recibidos son, entre otros, excluir a las Empresas Clasificadoras de Riesgo (ECR) del ámbito de aplicación del Reglamento GIR en línea con su exclusión de otros reglamentos de gestión de riesgos específicos, tales como el Reglamento de Gestión de Riesgo Operacional; y ampliar los plazos de envío del acuerdo de aprobación del Informe Anual de Riesgos y de la Declaración de Cumplimiento por parte del Directorio de la Entidad para coordinar la firma de las actas de los directorios presenciales o virtuales: 10 días hábiles posteriores al 31 de marzo y 5 días hábiles siguientes al 30 de abril, respectivamente.

El Reglamento GIR entrará en vigencia a partir del 1° de marzo de 2023. Las entidades deben implementar la GIR en los términos señalados por el Reglamento a partir del 30 de junio de 2024 para aquellas que no forman parte de un conglomerado financiero, del 31 de diciembre de 2023 para las que forman parte de un conglomerado financiero y del 30 de setiembre de 2024 para las Sociedades Administradoras de Plataformas de Financiamiento Participativo Financiero.

Lima, 23 de enero de 2023