

# Administración de Riesgos

Caja de Valores S.A.

Juan Carlos Falabella

Presidente

**XII Asamblea General de ACSDA**

**Tampa, Florida, Estados Unidos, Marzo 2010**

Caja de Valores opera en un contexto en que la seguridad, confidencialidad y confiabilidad son requisitos insoslayables para el regulador y para el público en general.

Por ello, pone cada vez mayor énfasis en el cumplimiento de su propia metodología de control y de las normativas del organismo de contralor.

A tales efectos se utilizan estrictas metodologías para la gestión de riesgos, de manera de lograr un óptimo balance entre riesgo y retorno del negocio.

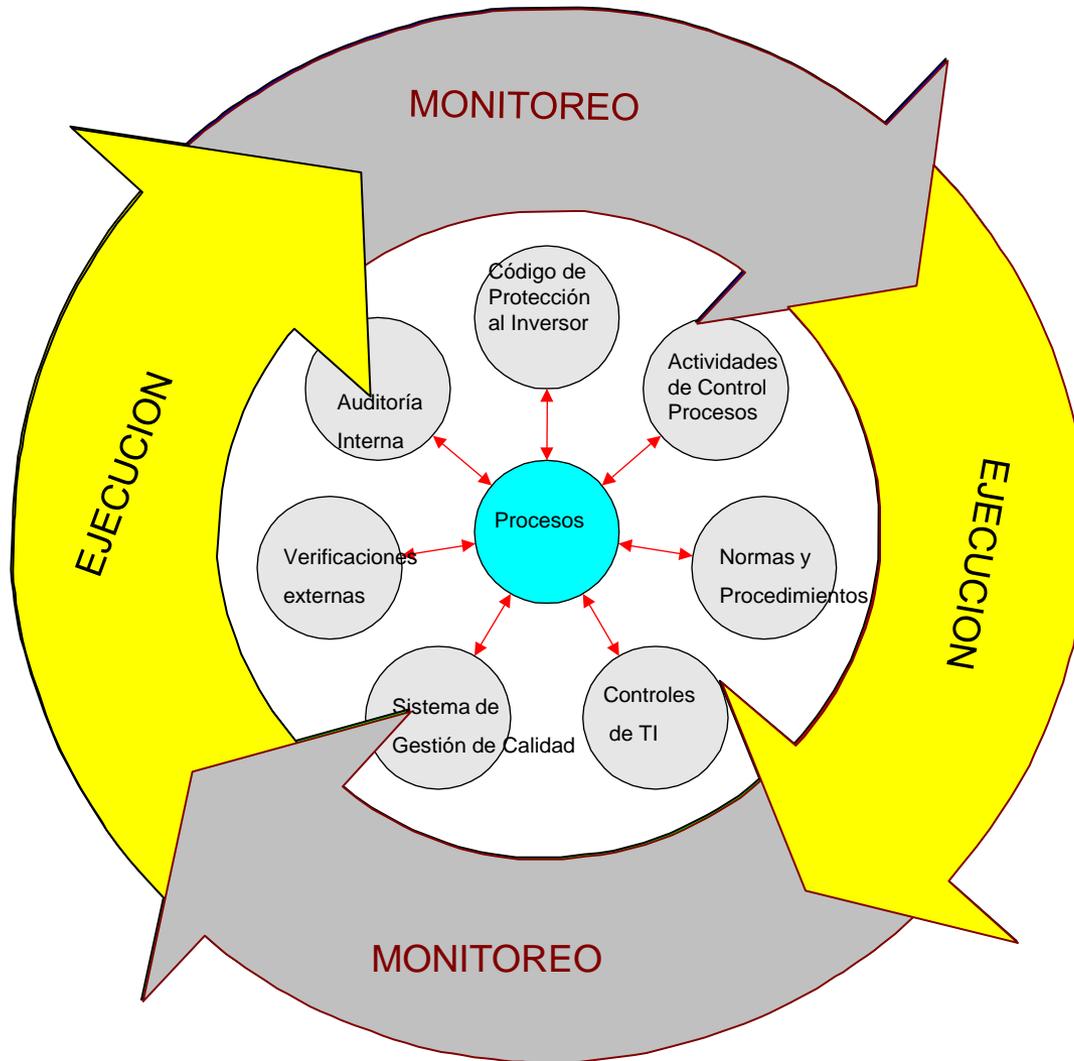
# Administración de Riesgos

## Procesos y subprocesos



# Administración de Riesgos

## Estructura de Control



# Administración de Riesgos

## Identificación de Riesgos



Balance ScoreCard que define 4 perspectivas para el desarrollo de las actividades. Estas perspectivas tienen plena correlación con los principales riesgos identificados de la organización:

PERSPECTIVA	RIESGO
Financiera	Inversiones
Clientes	Estratégico / Continuidad de Negocio
Procesos	Operacional y tecnológico
Capacitación / Know How	Errores

# Administración de Riesgos

## De la teoría a la práctica (cont.)



Operacional	Interrupción de las operaciones	Centro de Cómputos alternativo Vínculos redundantes Espejado de discos Plan de Recuperación
-------------	---------------------------------	--

# Administración de Riesgos

## De la teoría a la práctica (cont.)

Operacional	Pérdida de Valores	<p>Programa corporativo de cobertura de seguros</p> <p>Bóvedas con las más modernas medidas de seguridad, equivalentes a las entidades financieras</p> <p>Codificación y trazabilidad de Formularios</p>
-------------	-----------------------	--

# Administración de Riesgos

## De la teoría a la práctica (cont.)

Operacional	Sustitución de identidad	<p>Area de reconocimiento de identidad</p> <p>Implementación de sistemas con reconocimiento biométrico</p>
	Errores transaccionales	<p>STP interno</p> <p>STP externo con algunas entidades (Ministerio Economía)</p> <p>Sistema de Comunicaciones Seguras</p> <p>Acceso de inversores finales a sus Tenencias, por Internet</p>