



Universidad Nacional Mayor de San Marcos

Universidad del Perú. Decana de América

Facultad de Ingeniería de Sistemas e Informática

Unidad de Posgrado

**Modelo de gestión de continuidad del negocio por línea
de negocio según Basilea II, basado en ISO 22301, para
el sector financiero peruano: caso financiera TFC**

TESIS

Para optar el Grado Académico de Magíster en Ingeniería de
Sistemas con Mención de Gestión de Tecnología de Información
y Comunicaciones

AUTOR

Jesús Nieves QUEVEDO URIBE

ASESOR

Moisés VILLENA AGUILAR

Lima, Perú

2013

Modelo de Gestión de Continuidad del Negocio por Líneas de Negocio según Basilea II, basado en ISO 22301, para el Sector Financiero Peruano: caso Financiera TFC

RESUMEN

El problema tratado en la presente tesis es el requerimiento exigido por la Superintendencia de Banca, Seguros y Asociación de Fondo de Pensiones (SBS) a las entidades financieras peruanas para implementar la gestión de continuidad del negocio por líneas de negocio - según lo establecido en el Acuerdo de Basilea II - y ya no por procesos, tal y como los modelos a la fecha estudiados en el estado del arte lo desarrollan. Este trabajo propone un modelo de gestión de continuidad del negocio para las entidades financieras peruanas basadas en la gestión por líneas de negocio, alineado a la norma internacional ISO 22301:2012 y sus siete componentes, a las normas de la SBS, y a las mejores prácticas de los modelos especializados complementarios; de manera que dichas entidades cumplan con la normativa y se mantengan o puedan posteriormente postular – según sea el caso - al Método Estándar Alternativo de Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional. Para ello también se define una guía de seis pasos para su implementación, la cual ha sido validada a través del caso de estudio de Financiera TFC, donde se demuestra la aplicabilidad del modelo propuesto y el cambio en el alcance del sistema de gestión.

Palabras Claves: continuidad, negocio, riesgo, modelo.

Business Continuity Management Model by Business Lines according to Basilea II, based on ISO 22301, for Peruvian Financial Sector: case of Financiera TFC

ABSTRACT

The problem addressed in this thesis is the requirement made by Superintendencia de Banca, Seguros y Asociación de Fondo de Pensiones (SBS) to the peruvian financial institutions to implement the Business Continuity Mangement by business lines – accord to the established in Basilea II Agreement – and no more by processes, as models studied to date in the state of the art are developed. This work proposes a Business Continuity Model for the peruvian financial institutions based on management by the business lines, aligned to the international standard ISO 22301:2012 and its seven components, to the SBS policy, and to the best practices of complementary specialized models; so that such entities comply with the regulations and are maintained or can subsequently apply - as applicable - the Alternative Standardised Approach of Effective Patrimony Requirement for Operational Risk. This also defines a six-step guide for implementation, which has been validated through the case study of Financiera TFC, which shows the applicability of the proposed model and the change in the scope of the management system.

Key words: continuity, business, risk, model.