

REGLAMENTO DEL COMITÉ DE RIESGOS DE LA CAMARA DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA S.A.

Artículo 1. FINALIDAD: Definir las reglas que enmarcan el funcionamiento del Comité de Riesgos y de sus reuniones.

Artículo 2. CONFORMACION: El Comité de Riesgos estará integrado por cinco (5) miembros designados por la Junta Directiva, de los cuales por lo menos dos (2) deberán ser miembros de la Junta Directiva de la sociedad, que tengan el carácter de independientes.

PARÁGRAFO: Para ser designado miembro del Comité de Riesgos sin tener la calidad de miembro de la Junta Directiva, el aspirante deberá cumplir, además de los requisitos establecidos en los literales a), b) y c) del Parágrafo Primero del Artículo 50 de los Estatutos Sociales, y contar con una experiencia laboral y/o de ejercicio profesional independiente no inferior a cinco (5) años en las áreas de administración o gestión de riesgos, o financiera en el sistema financiero o en el mercado de valores en Colombia o en el exterior.

Corresponde a la Junta Directiva o al Comité que ésta designe, velar por el cumplimiento de estas calidades.

Artículo 3. PERÍODO: Los miembros del Comité de Riesgos serán elegidos para periodos de dos (2) años.

Artículo 4. REUNIONES: El Comité de Riesgos se reunirá en forma ordinaria una (1) vez al mes, en el día, hora y lugar indicados en la convocatoria formulada por el Secretario del Comité o el Gerente de la sociedad; se reunirá también en forma extraordinaria cuando lo convoquen dos (2) de sus miembros o el Gerente de la sociedad. La convocatoria a las reuniones se efectuará mediante comunicación escrita o correo electrónico con dos (2) días hábiles de antelación a la fecha de la reunión.

No obstante lo anterior, el Secretario del Comité podrá convocar a reuniones extraordinarias sin la antelación antes señalada, en casos que por su urgencia requieran de la toma de decisiones para evitar o controlar cualquier riesgo que puede afectar a la sociedad.

Artículo 5. PRESIDENTE DEL COMITÉ: Los miembros del Comité elegirán entre sus miembros al Presidente del Comité, quien ejercerá el cargo por un período de dos (2) años.

En caso de que el Presidente titular no pueda asistir a una de las reuniones citadas, los otros integrantes del Comité designarán entre sus miembros un Presidente para que ejerza como tal, únicamente durante la reunión para la cual está siendo designado.

El Presidente tendrá las siguientes funciones:

- a) Tener la vocería permanente del Comité.
- b) Presidir y dirigir las reuniones, así como las deliberaciones que surjan.

- c) Otorgar la palabra a los miembros del Comité.
- d) Anunciar los resultados de las votaciones.
- e) Firmar las actas del Comité.

Artículo 6. SECRETARIO DEL COMITÉ: El Secretario del Comité de Riesgos será designado por el Comité y tendrá las siguientes funciones:

- a) Efectuar la citación a las reuniones de conformidad con los estatutos con la anticipación requerida, adjuntando copia de la documentación de los temas que requerirán de decisión.
- b) Elaborar el orden del día de la reunión y remitirlo a los miembros del Comité.
- c) Velar por que la información que deban conocer los miembros del Comité, esté disponible en la forma y plazos requeridos.
- d) Verificar el quórum deliberatorio y decisorio de las reuniones.
- e) Elaborar y remitir a los Miembros del Comité las actas de cada reunión.
- f) Conservar y custodiar debidamente el libro de actas del Comité.
- g) Prestar a los miembros del Comité el asesoramiento y la información necesaria.

Artículo 7. PARTICIPANTES DEL COMITÉ: El Gerente, el Subgerente de Riesgos y Operaciones de la Cámara y el Secretario del Comité asistirán a las reuniones del Comité de Riesgos, con voz pero sin voto.

A los Comités de Riesgos se podrán citar o invitar a las personas cuyos informes o conceptos interesen a la sociedad, quienes tendrán voz pero no voto en las reuniones a las que asistan.

Artículo 8. QUORUM DELIBERATORIO: Habrá quórum para deliberar en las reuniones del Comité con la asistencia de tres (3) miembros de los cuales uno (1) deberá tener la calidad de independiente.

Artículo 9. MAYORIA DECISORIA: Cada miembro del Comité tendrá derecho a un (1) voto. Las decisiones del Comité se adoptarán con el voto favorable de la mitad más uno de los asistentes a la reunión, siempre y cuando en esa mayoría se incluya el voto favorable de un miembro independiente.

Artículo 10. REUNIONES NO PRESENCIALES: Cuando no fuere posible la asistencia presencial de los miembros del Comité o de parte de ellos en la sede principal de la Cámara o en el lugar a donde se haya convocado, podrá hacerse una reunión no presencial con los mismos requisitos de convocatoria, quórum y acta previstos en los Estatutos de la Cámara y tomarse decisiones válidas por cualquier medio de comunicación disponible en ese momento, aprovechando el desarrollo e innovación en los usos tecnológicos, siempre y cuando de ello quede prueba, la cual se anexará y hará parte del acta correspondiente.

Artículo 11. DECISIONES POR ESCRITO: La toma de decisiones por escrito de los Comités se sujetan a lo previsto sobre el particular en las normas previstas en la Ley 222 de 1995, en el Código de Comercio y en las demás normas que los desarrollen, modifiquen o sustituyan.

Artículo 12. LIBRO DE ACTAS: De todas las reuniones, deliberaciones, acuerdos y decisiones del Comité de Riesgos se dejará constancia en un libro de actas y éstas deberán

ser firmadas por el Presidente y el Secretario de dicho Comité. En las actas se dejará constancia del lugar, fecha y hora de la reunión, de la forma en que se haya hecho la convocatoria y del número de miembros asistentes a la reunión.

Los documentos conocidos por el Comité que sean sustento de sus decisiones deberán formar parte integral de las actas, por lo cual en caso de no ser transcritos deberán presentarse como anexos de las mismas. Así, cada vez que se entregue un acta, deberá suministrarse al interesado tanto el cuerpo principal de la misma como todos sus anexos, los cuales deberán estar adecuadamente identificados y foliados, y mantenerse bajo medidas adecuadas de conservación y custodia.

Artículo 13. FUNCIONES: El Comité de Riesgos tendrá las siguientes funciones:

- a) Elaborar y someter a consideración de la Junta Directiva las políticas de administración de riesgos de la Cámara.
 - b) Definir y adoptar el modelo y los mecanismos y procedimientos para la gestión del riesgo a que se exponen las operaciones que acepte la Cámara de Riesgo Central de Contraparte y las operaciones que se compensen y liquiden a través de la misma, así como el sistema de garantías, incluidos los recursos financieros, los fondos y en general las salvaguardas financieras necesarias para el control y protección de los riesgos.
 - c) Establecer mecanismos de monitoreo, medición y control de riesgos de las operaciones que acepte la Cámara de Riesgo Central de Contraparte y las operaciones que se compensen y liquiden a través de la misma. El control de riesgos se efectuará frente a las posiciones de las contrapartes, así como frente a la sociedad;
 - d) Establecer los mecanismos que le permitan a la sociedad prever y mitigar adecuadamente los riesgos de cumplimiento de las operaciones;
 - e) Establecer políticas de administración de riesgo y mecanismos claros y transparentes para los casos en que una o más de las contrapartes incumpla sus obligaciones o se presente un procedimiento concursal, de intervención, de toma de posesión, disolución o liquidación de una contraparte;
 - f) Determinar la forma y metodología para conformar los distintos fondos del sistema de garantías, estableciendo el tipo y porcentaje de los recursos que los integren, así como los criterios de administración de dichos recursos;
 - g) Presentar periódicamente informes sobre la gestión de riesgos a la Junta Directiva que le permitan a ésta hacer un adecuado control a la gestión de riesgos y monitorear la exposición de la sociedad. Como mínimo presentar un informe anual.
- En todo caso, la Junta Directiva podrá solicitar al Comité, en cualquier momento, informes extraordinarios sobre la gestión de riesgos y, en especial, sobre cualquier situación particular que se produzca en el mercado.
- h) Darse su propio reglamento, sin perjuicio de la autorización que deba dar la Junta Directiva de la Cámara;
 - i) Proponer a la Junta Directiva modificaciones a los reglamentos de la Cámara;
 - j) Designar al Presidente del Comité de Riesgos de su propio seno;
 - k) Designar al Secretario del Comité de Riesgos;
 - l) Ejercer las demás funciones que le señalen las leyes, los estatutos y los reglamentos.

Artículo 14. DEBERES DE LOS MIEMBROS DEL COMITÉ DE RIESGOS: Además de los deberes legales y de las funciones antes señaladas, los miembros del Comité de Riesgos deberán tener presente para el ejercicio de sus funciones, los siguientes deberes:

- a) Informar por escrito a la Junta Directiva, cualquier hecho o circunstancia que ocurra con posterioridad al inicio del ejercicio del cargo y que pueda implicar la pérdida de alguna de las calidades generales, o de las condiciones especiales exigidas para ser considerado miembro del Comité, inmediatamente tengan conocimiento de su ocurrencia, lo cual dará lugar automáticamente a la cesación en el ejercicio del cargo.
- b) Revelar oportunamente cualquier situación que pueda implicar potencialmente un conflicto de interés.
- c) Contar con el tiempo suficiente para el adecuado cumplimiento de sus funciones como miembro del Comité de Riesgos.
- d) Asistir puntualmente a todas las reuniones del Comité de Riesgos, participar activamente y prestar su colaboración para el desarrollo de las tareas encomendadas.

Artículo 15. PROHIBICIONES A LOS MIEMBROS DEL COMITÉ DE RIESGOS: Los miembros del Comité de Riesgos en el ejercicio de sus funciones no podrán:

- a) Revelar información que conozcan con ocasión de su calidad del miembro del Comité, aún después de cesar en sus funciones.
- b) Incurrir en conductas que puedan ocasionar un conflicto de interés.
- c) Entorpecer la buena marcha de las deliberaciones y/o actividades del Comité.
- d) Ausentarse sin justa causa de las reuniones del Comité.

Artículo 16. MODIFICACION DEL REGLAMENTO DEL COMITÉ: La aprobación y modificaciones al presente Reglamento deberán ser aprobadas previamente por la Junta Directiva de la Cámara.