



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

ANEXO 25

FORMULARIO DE ACTUALIZACIÓN DE REQUISITOS CUALITATIVOS

 Cámara de Riesgo Central de Contraparte	FORMULARIO DE REQUISITOS SUJETOS A CALIFICACIÓN.	Código: FO-GM-I011
	FORMULARIO DE REQUERIMIENTO CUALITATIVO	Versión: 1
		Página 1 de 1

Miembro Liquidador General	Miembro Liquidador Individual	Miembro No Liquidador
----------------------------	-------------------------------	-----------------------

1 Datos Generales de la Entidad

Razón Social: _____

Número de Identificación (NID): _____

Tipo de Entidad: Banco

Fecha de Constitución: _____

Dirección Electrónica: _____

2 Contacto con la Cámara de Riesgo Central de Contraparte (Responsable del diligenciamiento del Formulario)

Nombre: _____

Cargo: _____

Teléfono Oficina: _____ Teléfono Celular: _____ Teléfono Domicilio: _____

Dirección de Correo Electrónico: _____

3 Elabore y describa el organigrama funcional de la Área de Tesorería (Negociación, Análisis de Riesgos y Operaciones) y señale el número de funcionarios para cada nivel de la estructura jerárquica.

4 Describa de manera amplia y comprensiva la estructura y jerarquía de los Comités (Órganos Colegiados) asociados a la gestión de Riesgo y Operaciones, y explique por cada uno de ellos sus objetivos, funciones, miembros (cargos/áreas), periodicidad de reuniones y reglas de quórum deliberativo y decisorio.

5 Por favor describa los controles ejercidos por las áreas independientes sobre los niveles de atribución. Especifique si los mismos son anuales o automáticos

6 Registre en la Tabla 1 la descripción general de las políticas y lineamientos de riesgos

7 Identifique la periodicidad de las siguientes actividades asociadas al proceso de administración de riesgos:

a) Revisión La exactitud de los reportes producidos por el sistema de riesgos es revisada al menos una vez cada: Diaria

b) Verificación de la confiabilidad y exactitud de los controles sobre el cumplimiento de los lineamientos y atribuciones se realiza al menos: Diaria

c) Verificación de la confiabilidad y exactitud de los modelos de stress y back testing es verificada al menos una vez cada: Mensual

d) Evaluación de la confiabilidad y exactitud de los modelos de valoración, riesgos y límites de crédito se evalúa al menos: Semestral

e) La actualización de la documentación de los procedimientos de administración de riesgos. Semestral

8 Registre en la Tabla 2 las soluciones de software y proveedores tecnológicos que soportan los procesos de Riesgo y Operaciones.

Ver información Tabla 2

9 Registre en las Tabla 3 y 4 las características básicas del Plan de Contingencia y Continuidad de Negocio de la estructura de tecnología.

Ver información Tabla 3 y 4



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

Formulario de Requisitos Cualitativos						
						Observaciones
1		Por favor indique el número de analistas en las áreas de front, middle y back office				
		# de Analistas Front Office	# de Analistas Middle Office	# de Analistas Back Office		
2	¿Cuántos años de experiencia en el sector de funcionamiento de primer nivel en áreas de front, middle y back office?	¿Cuántos años de experiencia en el sector de funcionamiento de segundo nivel en áreas de front, middle y back office?	¿Cuántos años de experiencia en el sector de funcionamiento de tercer nivel en áreas de front, middle y back office?			-Funcionarios de primer nivel: se refiere a los funcionarios que corresponden a Vicepresidentes, Gerentes o Directores de área -Funcionarios de segundo nivel: se refiere a funcionarios que corresponden a Jefes o Coordinadores de área -Funcionarios de tercer nivel: se refiere a funcionarios que corresponden a Analistas de área
3	Niveles de Atribución	Para cuántos de los tres criterios (Productos-Portafolio-Volumen)	En primer orden por criterio, ¿cuántos niveles de atribución existen?	Cada cuánto (número de años) se actualizan los niveles de		¿En caso que no se hayan actualizado los niveles de atribución en los últimos 5 años, por favor indique cómo
4	¿Toma de decisiones frente a la CRCC?	Por favor indique con una X, en qué nivel de la organización se toman las decisiones sobre el proceso de negociación: Nivel 1: Nivel 2: Nivel 3: (se debe seleccionar al menos uno)				
		Por favor indique con una X, en qué nivel de la organización se toman las decisiones sobre el proceso de ganancias: Nivel 1: Nivel 2: Nivel 3: (se debe seleccionar al menos uno)				
		Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3		
		Por favor indique con una X, en qué nivel de la organización se toman las decisiones sobre otros temas: (Nivel 1: Nivel 2: Nivel 3: (se debe seleccionar al menos uno))				
		Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3		
5	¿Soporte sum instado por proveedores de tecnología?	Por favor señale la opción que corresponda al soporte sum instado por el proveedor				
		Soporte a Equipos de Computo		Telecomunicaciones		Seguridad Informática
		24x7	5x8	24x7	5x8	24x7
						5x8

Tablas 1.

crcc		FORMULARIO DE REQUISITOS SUJETOS A CALIFICACIÓN				Código: FO-GM-1011		
Cámara de Riesgo Central de Contraparte		FORMULARIO DE RQ CUALITATIVO				Versión: 1		
		FORMULARIO DE RQ CUALITATIVO				Página 1 de 1		
Tipo de Riesgo / Subtipo (Según la clasificación interna)		Descripción General de las Políticas y Lineamientos de Riesgos			Mecanismos de Medición y Monitoreo de Riesgos			
		Política / Lineamiento (1)	Instancia de aprobación (2)	Responsable de Control (3)	Metodología de Evaluación (4)	Indicadores (5)	Periodicidad de Monitoreo (6)	Documentación disponible (7)
Mercado	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
Operativo	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
Credito	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
Liquidez	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

Tabla 2.

Análisis y Control					Cumplimiento				
1. Sistema de Medición y Control Riesgo Mercado					5. Control de Riesgo Operativo				
Sotfware Proveedor/Desarrollador propio Versión Interfaz con					Sotfware Proveedor/Desarrollador propio Versión Interfaz con				
2. Sistema de Control de Riesgo de Crédito					2. Sistema Contable				
Sotfware Proveedor/Desarrollador propio Versión Interfaz con					Sotfware Proveedor/Desarrollador propio Versión Interfaz con				
3. Herramientas Estadísticas					3. Sistema de Valuación				
Sotfware Proveedor/Desarrollador propio Versión Interfaz con					Sotfware Proveedor/Desarrollador propio Versión Interfaz con				
4. Sistema de Control de Límites					4. Sistema de administración de garantías propias y de terceros				
Sotfware Proveedor/Desarrollador propio Versión Interfaz con					Sotfware Proveedor/Desarrollador propio Versión Interfaz con				

Tabla 3.

		FORMULARIO DE REQUERIDOS SUJETOS A CALIFICACIÓN								Código: FO-GM-1011
		FORMULARIO DE RQ CUARENTATRO								Versión: 1
										Página 1 de 1

PLAN DE CONTINGENCIA												
Condiciones para la puesta en marcha			Plan de contingencia específico									
Tipos de Eventos	Definición de escenarios	1. Área encargada de reportar y tomar decisiones.	2. Persona responsable de la contingencia.	3. Segunda persona responsable de la contingencia.	4. Mencione actividades operativas a declarar en contingencia	5. Actividades necesarias para activar la estructura tecnológica y operativa en contingencia.	6. Actividades para activar procesos especiales para atender servicio a los clientes y de dar cumplimiento en contingencia.	7. Actividades necesarias para dar cumplimiento a los clientes y de dar cumplimiento en contingencia.	8. Restricciones de otras actividades de servicio con el cliente en contingencia.	9. Definir forma de dar cumplimiento a contingencia y aplicar los procedimientos de atención a la operación normal.	10. Actividades necesarias para suspender la operación en contingencia y activar nuevamente la estructura tecnológica y operativa de la operación normal.	11. Mencione los integrantes de equipo de contingencia para cada escenario.
Eventos de	Evento											
	Evento											
	Evento											
	Evento											
Eventos de	Evento											
	Evento											
	Evento											
	Evento											
Eventos de	Evento											
	Evento											
	Evento											
	Evento											
Eventos de	Evento											
	Evento											
	Evento											
	Evento											



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

Tabla 4.

 Cámara de Riesgo Central de Contraparte		FORMULARIO DE REQUERIMIENTOS SUJETOS A CALIFICACIÓN										Código: F0 GM I011		
		FORMULARIO DE RQ CUALITATIVO										Versión: 1		
												Página 1 de 1		
Tipos de Eventos		EFECTIVIDAD DEL PLAN DE CONTINGENCIA								MANTENIMIENTO Y ACTUALIZACIÓN				
		CAPACITACIÓN								Actualización				
		14. Cuántas veces en el semestre, se realizan pruebas a cada plan de contingencia	15. Identifique las actividades realizadas para la aplicación de pruebas	16. Identifique las personas que ejecutaron las pruebas para cada escenario	17. Mediante las pruebas realizadas se identificaron inconsistencias en los procedimientos?	18. Se actualizaron los manuales correspondientes?	19. Existe actualización de las pruebas ejecutadas en cada plan de contingencia?	20. Cuántas veces en el semestre, se realizan capacitaciones para cada plan de contingencia	21. Una vez realizadas las pruebas, se capacitó al equipo de contingencia?	22. Cada vez que se realiza cambios en el plan de contingencia, se actualiza la documentación de contingencia?	23. Se actualiza la documentación de contingencia?	24. Se capacita al equipo de contingencia?	25. Cuando existen novedades de personal, el equipo de contingencia es informado?	26. Existe un directorio de las personas a cargo de cada evento de contingencia?
Eventos No		Incendio												
Eventos No		Terremoto												
Eventos No		Conflictos Cíviles												
Eventos No		Falta de Personal												
Eventos No		Problemas de Sistema												
Eventos No		Operaciones												
Eventos No		Administración												
Malfunciones		Hardware												
Malfunciones		Software												
Malfunciones		Red de Comunicaciones												
Malfunciones		Almacenamiento												
Malfunciones		Fuente de Energía												
Daños		Infracción al sistema												
Daños		Uso no autorizado de recursos												
Daños		Destrucción Física												