




Cámara de Riesgo Central de Contraparte

### ANEXO 3

## FORMATO DE REQUERIMIENTOS

Formulario:

 Cámara de Riesgo Central de Contraparte	FORMULARIO DE REQUERIMIENTOS SUJETOS A CALIFICACIÓN.	Código: FO GM1011
	FORMULARIO DE REQUERIMIENTO CUALITATIVO	Versión: 1
		Página 1 de 1

<input type="checkbox"/> Membro Liquidador General	<input type="checkbox"/> Membro Liquidador Individual	<input type="checkbox"/> Membro No Liquidador
--	---	---

- 1 **Datos Generales de la Entidad**  
 Razón Social: \_\_\_\_\_  
 Numero de Identificación (NIT): \_\_\_\_\_  
 Tipo de Entidad:    
 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 Doméstico: \_\_\_\_\_  
 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 decisoria.**
- 5 **Por favor describa los controles ejercidos por las áreas independientes sobre los niveles de atribución. Especifique si los mismos son manuales 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 de la exactitud de los reportes producidos por el sistema de riesgos es revisada al menos una vez cada:
  - b) Verificación de la confiabilidad y exactitud de los controles sobre el cumplimiento de los lineamientos y atribuciones se realiza al menos:
  - c) Verificación de la confiabilidad y exactitud de los modelos de stress y back testing es verificada al menos una vez cada:
  - d) Evaluación de la confiabilidad y exactitud de los modelos de valoración, riesgos y límites de crédito se evalúa al menos:
  - e) La actualización de la documentación de los procedimientos de administración de riesgos:
- 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 funcionarios de primer nivel en áreas de front, middle y back office?	Primer nivel de funcionarios de segundo nivel en áreas de front, middle y back office	Primer nivel de funcionarios 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	¿Para cuántos de los tests criterios (Productos-Portfolio-Volumen)?	En primer nivel por criterio, ¿cuántos niveles de atribución existen?	Cada cuánto (número de años) se actualizan los niveles de atribución?				4) En caso que no se hayan actualizado los niveles de atribución en los últimos 5 años, por favor cobarquese con	
4	¿Tomó decisiones frente a la CRCC?	Por favor indique con una X, en qué niveles la organización se tomó las decisiones sobre el proceso de negociación: Nivel1, Nivel2, Nivel3, además el Nivel1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10, 11, 12, 13, 14, 15, 16, 17, 18, 19, 20, 21, 22, 23, 24, 25, 26, 27, 28, 29, 30, 31, 32, 33, 34, 35, 36, 37, 38, 39, 40, 41, 42, 43, 44, 45, 46, 47, 48, 49, 50, 51, 52, 53, 54, 55, 56, 57, 58, 59, 60, 61, 62, 63, 64, 65, 66, 67, 68, 69, 70, 71, 72, 73, 74, 75, 76, 77, 78, 79, 80, 81, 82, 83, 84, 85, 86, 87, 88, 89, 90, 91, 92, 93, 94, 95, 96, 97, 98, 99, 100.						
		Por favor indique con una X, en qué niveles la organización se tomó las decisiones sobre el proceso de garantías: Nivel1, Nivel2, Nivel3, además el Nivel1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10, 11, 12, 13, 14, 15, 16, 17, 18, 19, 20, 21, 22, 23, 24, 25, 26, 27, 28, 29, 30, 31, 32, 33, 34, 35, 36, 37, 38, 39, 40, 41, 42, 43, 44, 45, 46, 47, 48, 49, 50, 51, 52, 53, 54, 55, 56, 57, 58, 59, 60, 61, 62, 63, 64, 65, 66, 67, 68, 69, 70, 71, 72, 73, 74, 75, 76, 77, 78, 79, 80, 81, 82, 83, 84, 85, 86, 87, 88, 89, 90, 91, 92, 93, 94, 95, 96, 97, 98, 99, 100.						
		Por favor indique con una X, en qué niveles la organización se tomó las decisiones sobre el proceso de pagos: Nivel1, Nivel2, Nivel3, además el Nivel1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10, 11, 12, 13, 14, 15, 16, 17, 18, 19, 20, 21, 22, 23, 24, 25, 26, 27, 28, 29, 30, 31, 32, 33, 34, 35, 36, 37, 38, 39, 40, 41, 42, 43, 44, 45, 46, 47, 48, 49, 50, 51, 52, 53, 54, 55, 56, 57, 58, 59, 60, 61, 62, 63, 64, 65, 66, 67, 68, 69, 70, 71, 72, 73, 74, 75, 76, 77, 78, 79, 80, 81, 82, 83, 84, 85, 86, 87, 88, 89, 90, 91, 92, 93, 94, 95, 96, 97, 98, 99, 100.						
		Por favor indique con una X, en qué niveles la organización se tomó las decisiones sobre el proceso de liquidación: Nivel1, Nivel2, Nivel3, además el Nivel1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10, 11, 12, 13, 14, 15, 16, 17, 18, 19, 20, 21, 22, 23, 24, 25, 26, 27, 28, 29, 30, 31, 32, 33, 34, 35, 36, 37, 38, 39, 40, 41, 42, 43, 44, 45, 46, 47, 48, 49, 50, 51, 52, 53, 54, 55, 56, 57, 58, 59, 60, 61, 62, 63, 64, 65, 66, 67, 68, 69, 70, 71, 72, 73, 74, 75, 76, 77, 78, 79, 80, 81, 82, 83, 84, 85, 86, 87, 88, 89, 90, 91, 92, 93, 94, 95, 96, 97, 98, 99, 100.						
5	¿Soporte suministrado por proveedores de tecnología?	Por favor señale la opción que corresponda al soporte suministrado por el proveedor						
		Soporte a Equipos de Computo		Telecomunicaciones		Seguridad Informática		
		24x7	5x8	24x7	5x8	24x7	5x8	

Tabla 1: Políticas de Riesgo

CRCC		FORMULARIO DE REQUISITOS SUJETOS A CALIFICACIÓN					Código: FOGM1011	
Cámara de Riesgo Central de Contraparte		FORMULARIO DE REQUISITOS CUALITATIVOS					Versión: 1	
							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)	
Mantenimiento	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
Operativo	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
Cálculo	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
Liquidación	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							
	Subtipo							

Tabla 2: Soluciones / Software



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

Análisis y Control					Cumplimiento				
1. Sistema de Medición y Control de Riesgo Mercado					5. Control de Riesgo Operativo				
1.1. Sistema de Medición y Control de Riesgo Mercado					5.1. Sistema de Control de Riesgo Operativo				
Sotfware					Sotfware				
Proveedor/ Desarrollo propio					Proveedor/ Desarrollo propio				
Versión					Versión				
Interfaz con					Interfaz con				
2. Sistema de Control de Riesgo de Crédito					2. Sistema Contable				
Sotfware					Sotfware				
Proveedor/ Desarrollo propio					Proveedor/ Desarrollo propio				
Versión					Versión				
Interfaz con					Interfaz con				
3. Herramientas Estadísticas					3. Sistema de Valuación				
Sotfware					Sotfware				
Proveedor/ Desarrollo propio					Proveedor/ Desarrollo propio				
Versión					Versión				
Interfaz con					Interfaz con				
4. Sistema de Control de Liquidación					4. Sistema de Administración de Garantías Propias y de Terceros				
Sotfware					Sotfware				
Proveedor/ Desarrollo propio					Proveedor/ Desarrollo propio				
Versión					Versión				
Interfaz con					Interfaz con				

Tabla 3: Plan de Contingencia

	FORMULARIO DE REQUERIDOS SUJETOS A CALIFICACIÓN	Código: PO-GM-1011
	FORMULARIO DE REQUERIMIENTOS	Versión: 1
		Página 1 de 1


Tipos de Eventos	PLAN DE CONTINGENCIA													
	Condiciones para la puesta en marcha					Plan de contingencia específico								
	Definición de escenarios	1. Área encargada de responder tomar decisiones.	2. Personal responsable de contingencia.	3. Seguridad persona cargo.	4. Mencione las actividades a las que se declaran contingencia	5. Actividades necesarias para activar procesos de infraestructura y operación en contingencia	6. Actividades para asegurar servicios a los clientes y operar en contingencia.	7. Actividades necesarias para mantener servicios operativos y de atención al cliente en contingencia.	8. Restricciones de acceso a las actividades de desarrollo y de atención al cliente en contingencia.	9. Definir forma para evaluar la contingencia y actuar nuevamente en caso de contingencia.	10. Actividades necesarias para suspender la operación en contingencia y actuar nuevamente en caso de contingencia.	11. Mencione los integrantes del equipo de contingencia para cada escenario	12. Se detallan los procedimientos necesarios para la ejecución de cada evento mal de contingencia.	13. Existen líneas de chequeo para seguir paso a paso las actividades en un evento mal de contingencia.
Eventos de Riesgo de Crédito	Dificultad de pagos													
	Confianza de crédito													
	Falta de Personal													
Eventos de Riesgo de Operación	Procesos de Sistema Operacionales													
	Acciones de Operación													
	Acciones de Operación													
Eventos de Riesgo de Tecnología	Redes de Comunicación													
	Redes de Comunicación													
	Fuente de Energía													
Eventos de Riesgo de Liquidación	Interrupción de sistemas													
	Procesos de Liquidación													
	Destrucción Física													

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

Tabla 4: Efectividad en Plan de Contingencia

		FORMULARIO DE REQUERIMIENTOS SUJETOS A CALIFICACIÓN										Código: FOGMIO11		
		FORMULARIO DE RQ CALIFICATIVO										Versión: 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 por 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 realicen cambios en el plan y/o adquisición de tecnología, se actualizan las pruebas de contingencia?	23. Se actualiza la documentación correspondiente?	24. Se capacita el equipo de contingencia?	25. Cuando existe novedades de personal el equipo de contingencia es informado?	26. Existe un director técnico de las personas a cargo de cada evento de contingencia?
Eventos de	Incendio													
	Terrorismo													
	Conflictos Civiles													
	Falta de Personal													
Emergencia	Fuga de Información													
	Operaciones													
	Administración													
Materiales	Hardware													
	Software													
	Redes de Comunicaciones													
	Almacenamiento													
Deducción	Fuente Eléctrica													
	Infracción al Sistema													
Deducción	Uso no autorizado de recursos													
	Destrucción Física													