

| | |
|---|--|
| <p>22. Seleccione las instancias de aprobación de los lineamientos de crédito. *</p> <p><input type="checkbox"/> Junta directiva</p> <p><input type="checkbox"/> Comités, Presidencia y Vicepresidencia</p> <p><input type="checkbox"/> Presidencia</p> <p><input type="checkbox"/> Vicepresidencia y/o comités internos</p> <p><input type="checkbox"/> <input type="text"/></p> <p>Otras</p> <p>23. Seleccione la periodicidad de la celebración del comité de riesgos. *</p> <p><input type="radio"/> Semanal</p> <p><input type="radio"/> Quincenal</p> <p><input type="radio"/> Mensual</p> <p><input type="radio"/> <input type="text"/></p> <p>Otras</p> | <p>24. Seleccione la periodicidad de la celebración del comité de gestión de activos y pasivos. *</p> <p><input type="radio"/> Semanal</p> <p><input type="radio"/> Quincenal</p> <p><input type="radio"/> Mensual</p> <p><input type="radio"/> <input type="text"/></p> <p>Otras</p> <p>25. Seleccione la periodicidad de la celebración del comité de inversiones. *</p> <p><input type="radio"/> Semanal</p> <p><input type="radio"/> Quincenal</p> <p><input type="radio"/> Mensual</p> <p><input type="radio"/> <input type="text"/></p> <p>Otras</p> <p>26. ¿Existen niveles de atribución para los criterios de producto, portafolio y volumen en la negociación? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> |
|---|--|

| <p>27. Seleccione si los controles sobre los niveles de atribución de portafolio, volumen y producto son automáticos o manuales. *</p> <p><input type="radio"/> Automáticos</p> <p><input type="radio"/> Manuales</p> <p><input type="radio"/> Algunos controles manuales y algunos controles automáticos</p> <p>28. Seleccione cada cuanto se realiza monitoreo al cumplimiento de las políticas y lineamientos de Riesgo. *</p> <p><input type="radio"/> Diario</p> <p><input type="radio"/> Semanal</p> <p><input type="radio"/> Quincenal</p> <p><input type="radio"/> <input type="text"/></p> <p>Otras:</p> <p>29. Indique cada cuanto realizan actualización de las políticas y lineamientos de Riesgos. *</p> <p><input type="radio"/> Cada seis meses o menos</p> <p><input type="radio"/> Entre seis meses y un año</p> <p><input type="radio"/> Superior a un año</p> | <p>30. Seleccione el nivel de los funcionarios responsables de la toma de decisiones frente a la CRCC en los temas relacionados con negociación, garantías y límites. *</p> <p>Entiéndase: nivel 1 como Vicepresidentes, gerentes, subgerentes o directores nivel 2 como coordinadores, jefes, supervisores nivel 3 como analistas, profesionales, auxiliares</p> <table><thead><tr><th></th><th>Nivel 1</th><th>Nivel 2</th><th>Nivel 3</th></tr></thead><tbody><tr><td>Negociación</td><td><input type="radio"/></td><td><input type="radio"/></td><td><input type="radio"/></td></tr><tr><td>Garantías</td><td><input type="radio"/></td><td><input type="radio"/></td><td><input type="radio"/></td></tr><tr><td>Límites</td><td><input type="radio"/></td><td><input type="radio"/></td><td><input type="radio"/></td></tr></tbody></table> <p>31. Seleccione la opción que más se asemeja a ¿Cómo la entidad realiza la gestión de garantías frente a la CRCC? *</p> <p><input type="radio"/> Monitoreo de riesgo a través del portal web para cubrir riesgo</p> <p><input type="radio"/> Esperar a que la CRCC realice llamado a constituir garantías</p> <p><input type="radio"/> Modelo establecido por la entidad</p> <p><input type="radio"/> <input type="text"/></p> <p>Otras:</p> | | Nivel 1 | Nivel 2 | Nivel 3 | Negociación | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | Garantías | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | Límites | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> |
|--|---|-----------------------|-----------------------|---------|---------|-------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|---------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Nivel 1 | Nivel 2 | Nivel 3 | | | | | | | | | | | | | | |
| Negociación | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | | | | | | | | | | | | | | |
| Garantías | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | | | | | | | | | | | | | | |
| Límites | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | <input type="radio"/> | | | | | | | | | | | | | | |

| Tecnología y Sistemas de Información | |
|--|---|
| <p>A continuación se evaluará la capacidad tecnológica de la entidad, su objetivo principal es garantizar la continua y eficiente comunicación e infraestructura para con la CRCC</p> | |
| <p>32. ¿La entidad posee canales tecnológicos que garantizan la comunicación con los aplicativos de Cámara? *</p> <p><input type="radio"/> Sí</p> <p><input type="radio"/> No</p> | <p>36. ¿La entidad cuenta con terminales con conectividad a la CRCC en distintas locaciones? *</p> <p><input type="radio"/> Sí</p> <p><input type="radio"/> No</p> |
| <p>33. ¿La entidad garantiza el cumplimiento de los requerimientos técnicos para el buen funcionamiento de los aplicativos de la CRCC? *</p> <p><input type="radio"/> Sí</p> <p><input type="radio"/> No</p> | <p>37. ¿La entidad cuenta con los requerimientos de hardware y software requeridos para la instalación y funcionamiento de los sistemas de la CRCC? *</p> <p><input type="radio"/> Sí</p> <p><input type="radio"/> No</p> |
| <p>34. ¿La entidad cuenta con al menos dos conexiones independientes (distintos canales) con la CRCC? *</p> <p><input type="radio"/> Sí</p> <p><input type="radio"/> No</p> | <p>38. ¿La entidad cuenta con distintos proveedores de internet? *</p> <p><input type="radio"/> Sí</p> <p><input type="radio"/> No</p> |
| <p>35. ¿Existen contratos vigentes con los proveedores de servicios de comunicaciones? *</p> <p><input type="radio"/> Sí</p> <p><input type="radio"/> No</p> | <p>39. ¿La entidad posee una solución tecnológica de registro de operaciones y Administración de terceros? *</p> <p><input type="radio"/> Sí</p> <p><input type="radio"/> No</p> |

| | |
|--|---|
| <p>40. ¿La entidad posee una solución tecnológica de Administración de Garantías propias y de terceros? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> <p>41. ¿La entidad posee soporte tecnológico 24 horas al día los 7 días de la semana? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> <p><input type="radio"/> <input type="text"/></p> <p>Otras</p> | <p>Operational Risk</p> <p>A continuación se evaluará el plan de continuidad de negocio de la entidad.</p> <p>42. ¿La entidad cuenta con un plan de continuidad de negocio? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> <p>43. Indique la periodicidad con la que se realizan las pruebas del plan de continuidad de negocio. *</p> <p><input type="radio"/> Una vez al año</p> <p><input type="radio"/> Dos veces al año</p> <p><input type="radio"/> Mas de dos veces al año</p> <p><input type="radio"/> Menos de una vez al año</p> <p>44. ¿Se realiza la documentación una vez realizadas las pruebas? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> <p>45. ¿La entidad ha realizado pruebas del plan de continuidad de negocio con otras infraestructuras? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> |
|--|---|

| | |
|--|---|
| <p>46. ¿La entidad cuenta con un centro alternativo de operaciones? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> <p>47. ¿La entidad cuenta con un centro de datos (datacenter) alternativo? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> <p>48. Si la entidad cuenta con un centro alternativo de operaciones. Seleccione la opción que más se ajuste a la ubicación de éste. *</p> <p><input type="radio"/> Distancia mínima requerida por la SFC</p> <p><input type="radio"/> En la misma ciudad</p> <p><input type="radio"/> En el mismo país</p> <p><input type="radio"/> Mismo continente</p> <p><input type="radio"/> Otro continente</p> <p>49. Seleccione la periodicidad con la que realizan capacitaciones sobre el plan de continuidad de negocio. *</p> <p><input type="radio"/> Una vez al año</p> <p><input type="radio"/> Dos veces al año</p> <p><input type="radio"/> Tres o más veces al año</p> | <p>50. ¿Realizan pruebas del plan de continuidad de negocio como mínimo una vez al año con sus proveedores críticos? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> <p>51. ¿La entidad cuenta con un sistema de Administración de Riesgo Operativo? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> <p>52. Seleccione cada cuánto la entidad realiza capacitación a sus funcionarios en temas relacionados con el Sistema de Administración de Riesgo Operativo *</p> <p><input type="radio"/> Mensual</p> <p><input type="radio"/> Trimestral</p> <p><input type="radio"/> Semestral</p> <p><input type="radio"/> Anual</p> <p><input type="radio"/> <input type="text"/></p> <p>Otras:</p> |
|--|---|

| | |
|---|--|
| <p>53. La entidad cuenta con perfil y mapas de riesgo asociados al Sistema de Administración de Riesgo Operativo *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> <p>54. ¿La entidad cuenta con una base de datos de eventos asociados al Riesgo Operativo? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> <p>55. ¿La entidad cuenta con una estructura organizacional asociada al Sistema de Administración de Riesgo Operativo? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> | <p>Seguridad de Información</p> <p>A continuación se evaluarán las políticas de seguridad de información y ciberseguridad de la entidad.</p> <p>56. ¿La entidad cuenta con políticas establecidas y documentadas de seguridad de información?</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> <p>57. ¿La entidad realiza capacitación constante a sus funcionarios sobre Seguridad de información y ciberseguridad?</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> <p>58. ¿La entidad cuenta con medidas para prevenir intrusiones de programas no autorizados como virus? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> <p>59. ¿La entidad cuenta con planes estratégicos para identificar y eliminar amenazas de ciberseguridad? *</p> <p><input type="radio"/> Si</p> <p><input type="radio"/> No</p> |
|---|--|

60. Por favor seleccione que medidas utiliza. *

- Software antivirus
 - Permisos restrictivos por usuario
 - Capacitación a funcionarios
 -
- Otras

61. ¿La entidad cuenta con procedimientos de respaldo de información en caso de un ataque informático? *

- Si
- No

62. Mencione los programas (software) que utiliza la entidad para protegerse del ciberataque. *



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

ANEXO 26

CONTENIDO MÍNIMO DE LA CLÁUSULA ESPECIAL PARA COMPENSAR Y LIQUIDAR A TRAVÉS DE LA CÁMARA OPERACIONES SOBRE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS NO ESTANDARIZADOS CELEBRADAS ENTRE LAS PARTES QUE TIENEN LA CALIDAD DE MIEMBROS DE LA CÁMARA DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA S.A.

Las Partes en su calidad de Miembros activos de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A., en adelante **LA CRCC** acuerdan compensar y liquidar través de **LA CRCC** con las particularidades que se establezcan por la Cámara para el Segmento que los agrupe, las operaciones celebradas entre sí sobre Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados de conformidad con los siguientes términos y condiciones:

1. Para la remisión de operaciones **Las Partes** darán cumplimiento estricto al Reglamento de Funcionamiento, la Circular Única y los Instructivos Operativos de **LA CRCC**.
2. Las operaciones sobre Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados que **Las Partes** celebren entre sí y pretendan compensar y liquidar a través de **LA CRCC** únicamente podrán remitirlas y confirmarlas a **LA CRCC** por intermedio de los sistemas de negociación y/o registro de operaciones autorizados por ésta y de acuerdo con lo dispuesto en el Reglamento de Funcionamiento de **LA CRCC**.
3. **Las Partes** aceptan que los derechos y obligaciones derivados de las operaciones sobre Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados celebradas entre sí, que se remitan a **LA CRCC** y que ésta acepte como contraparte, sean automáticamente novados, con ocasión de su remisión y de la interposición de **LA CRCC** como contraparte, surgiendo nuevos derechos y obligaciones de y frente a ésta y extinguiéndose los que hasta ese momento existieran entre **Las Partes** en relación con la operación sobre Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados. En ese sentido, una vez aceptada la operación celebrada sobre un Instrumento Financiero Derivado No Estandarizado, para

1306

compensación y liquidación por parte de **LA CRCC**, dicha operación será novada y se crearán dos nuevas operaciones cuyos términos económicos serán los de la operación original, una entre **la Parte A** y **LA CRCC** que actuará como contraparte del mismo, y otra entre **la Parte B** y **LA CRCC** que actuará también como contraparte del mismo.

4. **Las Partes** manifiestan que en virtud de la novación serán relevadas solamente de los derechos y obligaciones derivadas de la respectiva operación sobre el Instrumento Financiero Derivado No Estandarizado original, cuyo cumplimiento deba realizarse después de aceptada la operación por parte de **LA CRCC**.
5. **Las Partes** declaran que conocen y aceptan que el principio de finalidad establecido en las disposiciones legales vigentes y en el Reglamento de Funcionamiento de **LA CRCC** se extiende a las operaciones sobre Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados celebradas entre sí, aceptadas por **LA CRCC** en su función de contraparte desde el momento de su aceptación y se aplica a todos los actos necesarios para su cumplimiento, incluida la compensación a que se refiere el artículo 17 de la Ley 964 de 2005.
6. **Las Partes** declaran que si por cualquier razón ya sea de tipo operativo, tecnológico o de riesgo **LA CRCC** rechaza o no recibe una o varias operaciones sobre Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados celebradas entre sí, remitidas para su compensación y liquidación por parte de **LA CRCC**, dichas operaciones se seguirán rigiendo por el contrato o acuerdo original suscrito entre **Las Partes**, dichas operaciones serán vinculantes para **Las Partes** y por lo tanto, el cumplimiento de las mismas estará exclusivamente a su cargo en los términos del contrato celebrado por ellas.
7. **Las Partes** mantendrán a disposición de **LA CRCC** el original de la presente Cláusula, el cual podrá ser solicitado por **LA CRCC** en cualquier momento.
8. **Las Partes** se obligan a notificar en forma inmediata y por escrito a **LA CRCC** en el evento de terminación del Contrato Marco o de la presente Cláusula.

PARÁGRAFO PRIMERO: INTENCIÓN DE NOVAR EN EL CAMBIO DE DEUDOR.- **Las Partes** declaran expresamente que aceptan que cuando tengan la calidad de acreedores de la otra parte en una operación sobre un Instrumento Financiero Derivado No Estandarizado, su remisión a **LA CRCC** para la compensación y liquidación conllevará la liberación de la otra parte deudora.



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

PARÁGRAFO SEGUNDO: REGLAMENTO DE FUNCIONAMIENTO DE LA CRCC.- Las Partes declaran que las dos nuevas operaciones y las relaciones contractuales que se deriven de las mismas, así como sus efectos quedan sujetos a los términos de compensación y liquidación y se rigen exclusivamente por el Reglamento de Funcionamiento, las Circulares y los Instructivos Operativos de **LA CRCC**. En caso de discrepancia, incoherencia o contradicción entre los términos de compensación y liquidación y los términos económicos, prevalecerán los términos de compensación y liquidación.



1308



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

ANEXO 27

CONTENIDO MÍNIMO DEL ACUERDO PARA COMPENSAR Y LIQUIDAR A TRAVÉS DE LA CÁMARA DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA S.A. OPERACIONES SOBRE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS NO ESTANDARIZADOS CELEBRADAS ENTRE LAS PARTES.

Entre los suscritos a saber,, (“**Parte A**”), y....., (“**Parte B**”) y, conjuntamente con la **Parte A**, se denominarán “**Las Partes**”, han celebrado el presente acuerdo para compensar y liquidar a través de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A con las particularidades que se establezcan por la Cámara para el Segmento que los agrupe, Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados celebrados entre **Las Partes**, en adelante **EL CONVENIO**, previas las siguientes:

CONSIDERACIONES

1. Que **Las Partes** tienen la calidad de entidades vigiladas de la Superintendencia Financiera de Colombia.
2. Que **Las Partes** tienen la calidad de Miembros de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A., en adelante **LA CRCC**, y se encuentran debidamente afiliados y activos en el Sistema.
3. Que **Las Partes** tienen suscrito un Contrato Marco necesario para la negociación de Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados de conformidad con lo establecido en el Capítulo XVIII – Instrumentos Financieros Derivados y Productos Estructurados de la Circular Básica Contable y Financiera (Circular Externa 100 de 1995) de la Superintendencia Bancaria, hoy Superintendencia Financiera de Colombia.
4. Que el Contrato Marco está conformado por su texto y los anexos, un suplemento y las cartas de confirmación de las operaciones realizadas.
5. Que **Las Partes**, de acuerdo con el Contrato Marco, están facultadas para la celebración de operaciones sobre Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados.

6. Que de acuerdo con la normativa vigente, **LA CRCC** se encuentra autorizada para efectuar la Compensación y Liquidación como contraparte de Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados.
7. Que **LA CRCC** para interponerse como contraparte se constituirá como acreedora y deudora recíproca de los derechos y obligaciones que se deriven de las operaciones aceptadas, de conformidad con lo establecido en el Reglamento de Funcionamiento y con las particularidades que se establezcan por Circular para el Segmento que agrupe los Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados, asumiendo tal carácter frente a **Las Partes** en la operación de forma irrevocable, quienes mantendrán el vínculo jurídico con la contraparte central y no entre sí, operando de esta forma el fenómeno de la novación.
8. Que es intención de **Las Partes** remitir operaciones sobre Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados celebradas entre sí a **LA CRCC** para su Compensación y Liquidación como contraparte.

Dadas las anteriores consideraciones, **Las Partes** han convenido suscribir el presente **CONVENIO**, el cual se registrará por las siguientes:

CLÁUSULAS

PRIMERA: OBJETO.- El presente **CONVENIO** tiene como objeto establecer los términos y condiciones en los que **Las Partes** remitirán a **LA CRCC** las operaciones celebradas entre sí sobre Instrumentos Financieros Derivados No Estandarizados para su Compensación y Liquidación y novarán las obligaciones y derechos de las mismas en dichas operaciones, como consecuencia de la interposición de **LA CRCC** como contraparte central.

PARÁGRAFO. DEFINICIONES.- Los términos que se utilizan en este **CONVENIO**, cuya primera letra sea una mayúscula y que no se encuentren expresamente definidos en este **CONVENIO**, tendrán el significado que se les atribuye en el Reglamento de Funcionamiento de **LA CRCC**.

1310