



BOLETÍN NORMATIVO

Bogotá D.C., 23 de diciembre de 2013

No. 039

De conformidad con lo previsto en los artículos 1.4.4, 1.4.5 y 1.4.10 del Reglamento de Funcionamiento de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. – CRCC S.A., se publica:

TABLA DE CONTENIDO

No.	Circular	Páginas
035	ASUNTO: MODIFICACIÓN DEL ANEXO 25 DE LA CIRCULAR ÚNICA DE LA CÁMARA DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA S.A. - CRCC S.A. RELACIONADO CON LA ACTUALIZACIÓN DE REQUISITOS CUALITATIVOS DE LOS MIEMBROS DE LA CRCC S.A.	11


ASUNTO: MODIFICACIÓN DEL ANEXO 25 DE LA CIRCULAR ÚNICA DE LA CÁMARA DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA S.A. - CRCC S.A. RELACIONADO CON LA ACTUALIZACIÓN DE REQUISITOS CUALITATIVOS DE LOS MIEMBROS DE LA CRCC S.A.

De conformidad con lo previsto en los artículos 1.4.4, 1.4.5 y 1.4.10 del Reglamento de Funcionamiento de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. – CRCC S.A., se publica la modificación del Anexo 25 de la Circular Única de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. – CRCC S.A. relacionado con la actualización de Requisitos Cualitativos de los Miembros de la CRCC S.A.

Artículo Primero. Modifíquese el Anexo 25 de la Circular Única de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. – CRCC S.A., el cual quedará así:

“ANEXO 25

FORMULARIO DE ACTUALIZACIÓN DE REQUISITOS CUALITATIVOS

	FORMULARIO DE REQUISITOS SUJETOS A CALIFICACIÓN.	Código: FO GMI 011
	FORMULARIO DE RQ CUALITATIVO	Versión: 1
		Página 1 de 1

Miembro Liquidador General
 Miembro Liquidador Individual
 Miembro 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 Domicilio: _____

Dirección de Correo Electrónico: _____

3 Elabore y describa el organigrama funcional del Área de Tesorería - Front, Middle y Back - (su relación con el organigrama general de la Entidad) y señale la experiencia en el sector de cada funcionario, número de funcionarios por cada area (Front, Middle y Back) y encargados de la toma de decisión frente a la CRCC

4 Registre en la Tabla 1 la automatización, el nivel de integración con el sistema Core de la entidad y el uso de controles y alarmas automáticas sobre los procesos relacionados con la CRCC.

Procesos	Proceso Automatizado		Integración	Controles y Alarmas
	SI o NO	Herramienta de Oficina	Sistemas CORE	automáticas
			SI o NO	SI o NO
Gestión de garantías				
Liquidaciones diarias				
Liquidación al vencimiento por				
Administración de Límites				

5 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 quorum deliberativo y decisorio.

6 Niveles de atribuciones

¿Tienen niveles de atribuciones claramente identificados en la tesorería? SI ___ NO ___

Si la respuesta es Sí, Marque por cuales de los siguientes criterios se encuentran segregados

o Producto	___	¿Cuántos?	_____	Enumérelos:	1 _____	2 _____	3 _____	4 _____	...
o Portafolio/Fondos	___	¿Cuántos?	_____	Enumérelos:	1 _____	2 _____	3 _____	4 _____	...
o Volumen	___	¿Cuántos?	_____	Enumérelos:	1 _____	2 _____	3 _____	4 _____	...

¿Existen controles por parte de áreas independientes sobre los niveles establecidos? SI ___ NO ___

¿Cómo realizan los controles? _____

¿Cada cuánto se actualizan? _____ (años)

Adjunte la documentación detallada correspondiente a los Niveles de Atribución establecidos por la entidad

7 Registre en la Tabla 2. la descripción general de las estrategias y lineamientos de riesgos

8 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: Diana ▾
- b) Verificación de la confiabilidad y exactitud de los controles sobre el cumplimiento de los lineamientos y atribuciones se realiza al menos: Semanal ▾
- 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: Diana ▾
- e) La actualización de la documentación de los procedimientos de administración de riesgos. Semanal ▾

9 Registre en la Tabla 3. las soluciones de software y proveedores tecnológicos que soportan los procesos de Riesgo y Operaciones.

10 Señale en la Tabla 4 los proveedores de servicios y tipos de soporte con los que cuenta la entidad

Tabla 4. Proveedores de Servicios y Tipos de soporte

Información sobre Servicios Tecnológicos		
Servicio	Proveedor (Interno o Externo)	Tipo de Soporte (24x7 o 5x8)
Soporte a Equipos de Computo		
Telecomunicaciones		
Seguridad Informática		

11 Registre en las Tabla 5 y 6 las características básicas del Plan de Contingencia y Continuidad de Negocio

Tablas:

Tabla 2. Lineamientos de Riesgo:



		FORMULARIO DE REQUISITOS SUJETOS A CALIFICACIÓN.			FORMULARIO DE RQ CUALITATIVO				
					Código: FO GMI 011				
					Versión: 1				
					Página 1 de 1				
Tipo de Riesgo / Subtipo (Según la clasificación interna)	Descripción General Lineamientos de Riesgos / Estrategia			Mecanismos de Medición y Monitoreo de Riesgos					
	Lineamiento / Estrategia	Instancia de aprobación	Responsable de Control	Metodología de Evaluación	Indicadores	Periodicidad de Monitoreo	Documentación disponible	Incluida en Matriz de Riesgo (SI o NO)	
Mercado	Subtipo								
Crédito	Subtipo								
Operacional	Subtipo								
Liquidez	Subtipo								

Tabla 3. Soluciones Software:

		FORMULARIO DE REQUISITOS SUJETOS A CALIFICACIÓN.			FORMULARIO DE RQ CUALITATIVO		
					Código: FO GMI 011		
					Versión: 1		
					Página 1 de 1		
Análisis y Control				Cumplimiento			
1. Sistema de Medición y Control Riesgo Mercado		5. Control de Riesgo Operativo		1. Sistema de Registro de Operaciones - Administración de terceros			
Software		Software		Software			
Proveedor/ Desarrollo propio		Proveedor/ Desarrollo propio		Proveedor/ Desarrollo propio			
Versión		Versión		Versión			
Interfaz con		Interfaz con		Interfaz con			
2. Sistema de Control de Riesgo de Crédito				2. Sistema Contable			
Software				Software			
Proveedor/ Desarrollo propio				Proveedor/ Desarrollo propio			
Versión				Versión			
Interfaz con				Interfaz con			
3. Herramientas Estadísticas				3. Sistema de Valoración			
Software				Software			
Proveedor/ Desarrollo propio				Proveedor/ Desarrollo propio			
Versión				Versión			
Interfaz con				Interfaz con			
4. Sistema de Control de Llamadas				4. Sistema de administración de garantías propias y de terceros			
Software				Software			
Proveedor/ Desarrollo propio				Proveedor/ Desarrollo propio			
Versión				Versión			
Interfaz con				Interfaz con			

Artículo Segundo. Vigencia. La presente modificación a la Circular Única de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A., rige a partir del día veinticuatro (24) de diciembre de 2013.

(Original Firmado)
OSCAR LEIVA VILLAMIZAR
Gerente