

Contenido

OBJETIVO	<p>Administrar permanentemente el Riesgo de Mercado del ICETEX para mejorar el desempeño financiero de las operaciones de inversión de la Entidad, frente a las exposiciones de riesgo, teniendo en cuenta el rendimiento del portafolio de inversiones, de acuerdo con las políticas, metodologías, medición y mecanismos de control aprobados por la Junta Directiva.</p> <p>Alineado con los objetivos estratégicos de desdoblamiento de la Oficina de Riesgos "Contribuir a asegurar la sostenibilidad de los servicios manteniendo niveles competitivos de rentabilidad".</p>
ALCANCE	Inicia con la Medición y Transmisión del VaR y finaliza con el monitoreo y elaboración de informes.
IDER PROCESO	Jefe de Oficina de Riesgos.

PROVEEDORES	ENTRADAS	ACTIVIDADES	SALIDAS	CLIENTES
<ul style="list-style-type: none"> Junta Directiva Superintendencia Financiera de Colombia –SFC. Proceso Gestión de Inversiones. Proceso Gestión presupuestal Proceso Gestión contractual Entidades que reportan información financiera a través de la web. Entidades calificadoras de Riesgo avaladas por la Superintendencia financiera de Colombia. Proceso Gestión Contable y Tributaria. Proceso Planeación Estratégica 	<ul style="list-style-type: none"> Reglamentación Interna (Acuerdos y Resoluciones). Circular Externa 100 de 1995 – Capítulo XXIII Información financiera de las entidades vigiladas por la SFC. Propuesta de inversión. Formato Operaciones Cerradas (F267) Ticket de compra Acuerdo de aprobación del presupuesto Resolución de desagregación del presupuesto aprobado Acuerdo de modificación del presupuesto aprobado Contrato o convenio, carta de aceptación, orden de compra o suscrito y legalizado Información económica, financiera y de mercado. Calificación pública de riesgo de las entidades como de las emisiones. Valor de mercado de los diferentes portafolios de inversión del ICETEX Plan Estratégico 	<p>PLANEAR</p> <ul style="list-style-type: none"> Define los procedimientos y parámetros de identificación, medición, control y monitoreo que conforma el sistema de administración de Riesgo de Mercado. Identificar los recursos físicos, tecnológicos, financieros, de contratación y humanos que se requieran para el correcto funcionamiento del proceso. <p>HACER</p> <ul style="list-style-type: none"> Realiza informe diario del comportamiento del riesgo de mercado (Análisis de VaR, control de límites, cupos) Realizar informe semanal de SARM (Análisis de VaR, control de límites, cupos, comportamiento del mercado) Actualiza el modelo de otorgamiento de emisor y contraparte con la información financiera y de mercado. Revisa y realiza pruebas de escritorio aleatoriamente sobre la valoración realizada por la herramienta utilizada para ello. Realiza pruebas de escritorio aleatoriamente sobre el cálculo de valor en riesgo, realizado por la herramienta utilizada para ello. <p>VERIFICAR</p> <ul style="list-style-type: none"> Valida que la información generada de VaR esté correcta y que la SFC recibió el formato a conformidad. Verifica el valor del VaR con respecto a los aplicativos de información financiera. <p>ACTUAR</p> <ul style="list-style-type: none"> Modifica y envía archivo plano de VaR a Contabilidad Corrige Informe de Análisis de Comportamiento del Mercado. Elabora solicitud de ajuste a los aplicativos de información financiera e información gerencial, o memorando a Dirección de Tesorería solicitando ajuste a parámetros. Identifica y analiza los motivos de negación de cupos de cada una de las entidades. Realiza acciones correctivas, preventivas y de mejora requeridas 	<ul style="list-style-type: none"> Informe comportamiento de Riesgo de Mercado Informe semanal de SARM-SARL Archivo de transmisión del VaR Análisis financiero cupos (emisor y contraparte). Presentación a Comité Financiero Presentación a Junta Directiva Informe pruebas valoración Boletín mercado cambiario Necesidades de contratación Documentos requieren ser archivados. Información para comunicar externamente. Información para comunicar internamente Información para publicar en página web, infoservicio, SMS, email Marketing. Requerimientos tecnológicos. Acciones correctivas y de mejora. Cálculo de indicadores. Avance planes de acción. 	<ul style="list-style-type: none"> Alta dirección Superintendencia Financiera de Colombia. Comité Financiero y de Inversiones. Junta Directiva. Proceso Gestión de Inversiones. Proceso Gestión Contractual Proceso Gestión de archivo Proceso Gestión de Comunicación Externa. Proceso Gestión de Comunicación Organizacional. Proceso Gestión Comercial y de Mercadeo. Proceso Gestión de Servicios Tecnológicos. Proceso Evaluación Independiente. Proceso Planeación Estratégica

RECURSOS	REGISTROS GENERADOS	DOCUMENTOS RELACIONADOS	SEGUIMIENTO Y MEDICIÓN
-----------------	----------------------------	--------------------------------	-------------------------------

RECURSOS	REGISTROS GENERADOS	DOCUMENTOS RELACIONADOS	SEGUIMIENTO Y MEDICIÓN
HUMANOS <ul style="list-style-type: none"> Vicepresidente Financiero. Jefe de Oficina de Riesgos. Director de Tesorería. Profesional Especializado 03 - Oficina de Riesgos. Analista 03 – Oficina de Riesgo. Analista 03- Dirección de Tesorería. Analista 02 – Dirección de Contabilidad. Técnico Administrativo – Oficina de Riesgos. 	<ul style="list-style-type: none"> Listado Maestro de Registros 	<ul style="list-style-type: none"> Procedimiento Pruebas de escritorio valoración de inversiones. Procedimiento Medición y transmisión del VaR. Procedimiento Análisis del comportamiento del mercado. Procedimiento Asignación de cupos por emisor y contraparte. Procedimiento Monitoreo de cupos emisor y contraparte - seguimiento diario de cupos. Manual del Sistema de Administración de Riesgo de Mercado Procedimiento Administración archivos de gestión Procedimiento generación de correspondencia interna. Procedimiento recepción de correspondencia. Revisión por la dirección. Generación y seguimiento de acuerdos de servicio. Acciones Correctivas y de mejora. Control de documentos. Guía Metodología para el levantamiento de información. Guía para la elaboración de documentos. Guía metodológica para la gestión de oportunidades 	ESTRATÉGICO <ul style="list-style-type: none"> Evaluación Financiera de emisores
TECNOLÓGICOS <ul style="list-style-type: none"> Bloomberg. MS Office. Aplicativo Métrica. Aplicativo Sevinpro. Internet Matlab 			
INFRAESTRUCTURA <ul style="list-style-type: none"> Edificio, espacio de trabajo y servicios asociados. (Archivo móvil, muebles estantería, archivadores, sillas, mesas de reunión). Equipo para los procesos (Hardware) tales como: PC, portátiles, impresoras. Servicios de Apoyo (Fax, teléfonos, insumos, papelería y video beam). 			

RIESGOS ASOCIADOS	REQUISITOS APLICABLES
Mapa Integral de Riesgos del Proceso de Riesgo de Mercado. (Consulte el Mapa de Riesgo a través del aplicativo VIGIA)	LEGALES Y REGLAMENTARIOS <ul style="list-style-type: none"> Normograma
MAPAS ESTRATÉGICOS <ul style="list-style-type: none"> Mapa Estratégico Corporativo Mapa Desdoblamiento Oficina de Riesgos 	NORMA ISO 9001:2015 <ul style="list-style-type: none"> 4.1 Requisitos Generales 4.2.3 Control de documentos 4.2.4 Control de Registros 5.6.2 Información de entrada para la Revisión 7.5.1 Control de la producción y de la prestación del servicio. 8.2.3 Seguimiento y Medición de los procesos 8.5.1 Mejora Continua 8.5.2 Acciones Correctivas 8.5.3 Acciones preventivas

Modificaciones

Descripción de cambios

En proveedores se incluye junta directiva con reglamentación interna (acuerdos y resoluciones)

En la entrada circular externa 100 de 1995 se especifica Capítulo XXIII

Historial de Versiones

Fecha Vigencia (Acto Adtvo)	Versión	Descripción de Cambios
2019-10-25	17	<p>En proveedores se incluye junta directiva con reglamentación interna (acuerdos y resoluciones)</p> <p>En la entrada circular externa 100 de 1995 se especifica Capítulo XXIII</p>
2018-5-4	16	<ul style="list-style-type: none"> Se alinearon los objetivos estratégicos e indicadores 2018. Se alinearon los requisitos de la norma ISO 9001:2015. Se modificaron salidas y entradas transversales. Se modificaron el nombre de los procesos de Gestión de Servicios Tecnológicos, Administración de la Cartera, Gestión de comunicación externa, Gestión de comunicación organizacional. Se revisaron y actualizaron los hipervínculos. Se elimina la salida "Informe VaR" que tenía como cliente a la SuperFinanciera. Se modifica el nombre de la primera salida y segunda salida las cuales se envían al Comité Financiero y Junta Directiva estas salidas ahora se llaman "Presentación Comité Financiero" y "Presentación Junta Directiva".
2017-5-8	15	<ul style="list-style-type: none"> Se modificaron los objetivos del proceso alineándolos al Plan estratégico 2016-2020. Se modificó el indicador estratégico "Límite del VaR" por el indicador "Seguimiento a los Límites de exposición de Riesgo de Mercado". En los RIESGOS ASOCIADOS se modificó el link del Aplicativo VIGIA por el siguiente texto "Mapa Integral de Riesgos del Proceso de Riesgo de Mercado. (Consulte el Mapa de Riesgo a través del aplicativo VIGIA)". Se agrega la actividad "Identificar los recursos físicos, tecnológicos, financieros, de contratación y humanos que se requieran para el correcto funcionamiento del proceso." en el planear Se modifica la salida "Estudio previo de conveniencia y oportunidad" por "Necesidad de contratación" con el mismo cliente.
2016-8-18	14	<ul style="list-style-type: none"> Se agrega en el planear la actividad de identificación de los recursos. Se elimina la actividad del hacer "Reporta provisión según tabla definida por la SFC". Se elimina la salida "Informe de calificación de riesgo para la constitución de provisiones de inversiones de los portafolios del ICETEX" que se enviaba a la Contraloría y demás Entes de Vigilancia y Control. Se modifica la salida "Estudio de conveniencia y oportunidad" para el proceso precontractual por "Necesidades de contratación". Se elimina el procedimiento "Constitución de provisiones" de los documentos relacionados dado que este se eliminó.
2016-04-04	13	<ul style="list-style-type: none"> Se Incluye como salida el Informe de VAR

2015-07-28	12	<ul style="list-style-type: none"> Se ajustaron los proveedores, entradas, salidas y clientes. En el módulo de documentos relacionados se agregó el Manual del Sistema de Administración de Riesgo de Mercado
2015-5-19	11	<ul style="list-style-type: none"> Se elimino lo correspondiente a el reporte de portafolios eficientes, ya que este reporte debe realizarlo la vicepresidencia financiera
2014-10-09	10	<ul style="list-style-type: none"> Se eliminaron registros relacionados y se incluyó hipervínculo de listado maestro de registros. Se eliminaron Requisitos legales y reglamentarios y se incluyó hipervínculo de normograma. Se actualizaron objetivos estratégicos e indicadores.
2014-04-03	9	<ul style="list-style-type: none"> Objetivos: Se ingresa el nuevo objetivo estratégico alineado al proceso. Seguimiento y Medición: Se ingresa el indicador asociado al objetivo estratégico. Documentos y registros relacionados: Se revisaron los documentos relacionados y sus hipervínculos.
2013-12-23	8	<ul style="list-style-type: none"> Se modifica el objetivo en cuanto a que se reemplaza Tesorería por Operaciones de Inversión. Se modifica el alcance del proceso. Se ajustan las actividades del PHVA Se ajustan los requisitos aplicables en cuanto a los legales y reglamentarios. Se ajustan las salidas y los clientes de la caracterización.
2013-5-27	7	<p>Se incluye el procedimiento de Presentación y aprobación Políticas y de estudios Institucionales, el cual va ser un documento transversal a todas las caracterizaciones debido a la eliminación del proceso Generación o ajuste de políticas institucionales.</p>
2012-09-24	6	<p>Se incluye un nuevo campo relacionado con Mapas Estratégicos, en el cual se proporciona un link para consultar el mapa Corporativo y el mapa del desdoblamiento relacionado.</p>
2012-06-04	5	<ul style="list-style-type: none"> Actualización en objetivos e indicadores y ciclo PHVA y normatividad
21/10/2011	4	<p>Adiciona a las normas aplicables el Decreto 2555 de julio de 2010 del Ministerio de Hacienda y Crédito Público</p>

14/03/2011 3

- El proceso Gestión de Archivo se le eliminó "y Títulos valores"
- En clientes se eliminó el proceso Mejoramiento continuo y salida Acciones correctivas, preventivas y de mejora.
- Se agregaron los procedimientos : Autoevaluación del control, Revisión por la dirección, Generación y seguimiento de acuerdos de servicio, Acciones Correctivas, preventivas y de mejora, Control de documentos, Control de Registros, Guía Metodología para desarrollar la encuesta autoevaluación del control, Guía Metodología para el levantamiento de información, Guía para la elaboración de documentos.
- Ajuste en el nombre del procedimiento Administración archivos de gestión.
- Se agregaron los numerales de la norma NTCGP 1000:2009 e ISO 9001:2008:
 - 4.1 Requisitos Generales
 - 4.2.3 Control de documentos
 - 4.2.4 Control de Registros
 - 5.6.2 Información para la Revisión
 - 8.2.3 Seguimiento y Medición de los procesos
 - 8.5.1 Mejora Continua
 - 8.5.2 Acciones Correctivas
 - 8.5.3 Acciones preventivas

6/5/2010 2

Proveedores, entradas, salidas, clientes, actividades del planear, Hacer, verificar y actuar, Registros generados, documentos relacionados Talento Humano, Tecnología, Normatividad y los numerales que le aplican a la norma de calidad NCTGP 1000:2009

- 1.0 -