


<b>Código: F92</b>	<b>INFORME DE AUDITORIA</b>	
<b>Versión: 1</b>		
<b>Fecha: 04/11/2008</b>		
<b>Página 1 de 2</b>		

<b>FECHA:</b>	<b>26-05-2015</b>	<b>PROCESO AUDITADO:</b>	<b>GESTIÓN DE RIESGO DE MERCADO</b>
<b>LIDER DEL PROCESO:</b>	<b>JEFE OFICINA DE RIESGOS- CESAR MORALES</b>	<b>AUDITADOS:</b>	Cesar Morales- Jefe oficina de riesgos Amanda Triana. Profesional especializado Gerardo Gutiérrez- Analista
<b>AUDITOR LÍDER:</b>	<b>ARIADNA SALAS S.- ASCAL</b>	<b>EQUIPO AUDITOR:</b>	

### 1. OBJETIVO:

Evaluar los niveles de planeación, documentación, aplicación y eficacia del proceso, de acuerdo con los requisitos de NTCGP1000, ISO 9001 y MECI 1000 aplicables.

### 2. ALCANCE

Proceso completo y los procedimientos de:

- Pruebas de escritorio valoración de inversiones
- Medición y transmisión del Var
- Análisis del comportamiento del mercado
- Asignación de cupos por emisor y contraparte
- Monitoreo de cupos emisor y contraparte – seguimiento diario de cupos
- Constitución de provisiones

### 3. FORTALEZAS

- La gestión de riesgo de mercado, que la entidad ha definido aplicar para todo el portafolio de inversiones, aunque obligatoriamente se debe hacer solo para el TAE.
- El uso de herramientas tecnológicas que fortalecen la operación, aumentan la eficiencia, reducen el riesgo de error por procesamiento manual.
- Aprovechamiento de la entidad de toda la información que se genera desde la gestión del riesgo para la toma de decisiones.

### 4. DEBILIDADES Y OPORTUNIDADES DE MEJORA

NA.

### 5. NO CONFORMIDADES

NA

<b>Código: F92</b>	<b>INFORME DE AUDITORIA</b>	
<b>Versión: 1</b>		
<b>Fecha: 04/11/2008</b>		
<b>Página 2 de 2</b>		

## 6. CONCLUSIÓN

Para las actividades y procedimientos auditados, el proceso cumple con las condiciones de planeación, ejecución, verificación y mejora continua establecidas en la normatividad, en los requisitos de NTC GP 1000, ISO 9001 y MECI 1000 aplicables, aportando al logro de los objetivos institucionales.



ARIADNA SALAS SANCHEZ

**Firma Auditor**