

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

FECHA:	9-05-2018	PROCESO AUDITADO:	Gestión de Riesgo Mercado
LIDER DEL PROCESO:	David Rodríguez Lara	AUDITADOS:	Mónica Pinto-Profesional de Riesgo Operativo y Líder de Calidad Amanda Triana-Profesional Especializado 3 Katherin Aroca-Técnico Administrativo
AUDITOR LÍDER:	Clara Gutiérrez S	EQUIPO AUDITOR:	N.A.

1. OBJETIVO

Evaluación de la conformidad del proceso con los requisitos de la Norma ISO 9001:2015, la política y objetivos pertinentes.

2. ALCANCE

Requisitos ISO 9001:2015:

6. Planificación

6.1 Acciones Para abordar Riesgos y oportunidades

7.1.3 Infraestructura

7.1.4 Ambiente

7.1.5.1/2 Recursos de seguimiento y medición 10. Mejora

8.5.1 Producción y provisión del servicio 8.6 Liberación de los productos y servicios

9.1 Seguimiento, Medición, Análisis Y Evaluación

9.1.1 Generalidades

9.1.3 Análisis Y Evaluación

10.1 Generalidades

10.2 No Conformidad Y Acción Correctiva

10.3 Mejora Continua

Procedimientos:

- Pruebas de escritorio valoración de inversiones
- Medición y transmisión del Var
- Análisis del comportamiento del mercado
- Asignación de cupos por emisor y contraparte
- Constitución de provisiones
- Revisión de indicadores del proceso y normograma.
- Revisión del mapa de riesgos
- Seguimiento y cierre de no conformidades de auditorías anteriores

3. FORTALEZAS

La competencia y toma de conciencia del personal, evidente durante toda la auditoria.

La infraestructura y los recursos con los que cuenta ICETEX para el cumplimiento del SGC

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

4. DEBILIDADES Y OPORTUNIDADES DE MEJORA

- Revisar la causa 2 ERROR EN EL CÁLCULO de las aplicaciones que corren el proceso Var, ya que es el mismo riesgo identificado "Cálculo erróneo del VaR"
- Reevaluar las metas de los indicadores de tal manera que se fomente la mejora continua y se diferencien claramente cuáles son operativos, de gestión y estratégico.
- Revisar si las limitaciones de los recursos adicionales están consideradas en la evaluación de riesgos
- Considerar los controles de productos no conformes para los procesos que como resultado tengan productos relevantes para la toma de decisiones

5. NO CONFORMIDADES

No se detectaron no conformidades en la muestra auditada

6. CONCLUSIÓN

EL proceso cumple con el objetivo establecido y con los requisitos iso 9001:2015 evaluados


FIRMA AUDITOR