

Contenido

---

COPIA CONTROLADA

<b>OBJETIVO</b>	<p>Garantizar el adecuado manejo del portafolio de las inversiones del ICETEX, por medio de la administración del riesgo y la diversificación de este, conservando siempre el capital invertido, enmarcado dentro de la normatividad vigente.</p> <p>Alineado con los objetivos estratégicos de la Vicepresidencia Financiera: "Contribuir a la sostenibilidad financiera mediante la optimización de la rentabilidad acorde a las condiciones del mercado"</p>
<b>ALCANCE</b>	Inicia con la elaboración de la propuesta de inversión y finaliza con la conciliación del portafolio de inversiones.
<b>LÍDER PROCESO</b>	Vicepresidencia Financiera

PROVEEDORES	ENTRADAS	ACTIVIDADES	SALIDAS	CLIENTES	
<ul style="list-style-type: none"> <li>Gobierno Nacional (Congreso Nacional).</li> <li>Superintendencia Financiera de Colombia.</li> <li>Depósitos Centralizados de valores (Deceval y DCV).</li> <li>Fiduciaria.</li> <li>Gestión de Riesgo de Mercado.</li> <li>Proceso Gestión de Pagos y Liquidez</li> <li>Proceso Gestión presupuestal</li> <li>Proceso contractual</li> <li>Proceso Planeación estratégica</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Decreto 2792</li> <li>Circular No. 100 Capítulo I.</li> <li>Extractos de los depósitos centralizados de valores.</li> <li>Portafolio de inversión.</li> <li>Boletín riesgo de mercado</li> <li>Informe pruebas valoración.</li> <li>Cumplimiento compra de divisas</li> <li>Acuerdo de aprobación del presupuesto</li> <li>Resolución de desagregación del presupuesto aprobado</li> <li>Acuerdo de modificación del presupuesto aprobado</li> <li>Contrato o convenio, carta de aceptación, orden de compra o servicio suscrito y legalizado</li> <li>Plan estratégico</li> </ul>	<p><b>PLANEAR</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Gestionar el acceso a los aplicativos para soportar la operación de los sistemas:               <ul style="list-style-type: none"> <li>Sistema Financiero (APOTEOSYS).</li> <li>Sistema de administración del portafolio de inversión (SEVINPRO).</li> <li>Sistema del depósito centralizado de valores "Deceval".</li> </ul> </li> <li>Identifica la disponibilidad de recursos a invertir en los portafolios de inversión.</li> <li>Analiza los cupos disponibles.</li> <li>Analiza la composición del portafolio actual.</li> <li>Garantiza el funcionamiento al interior del ICETEX de los depósitos centralizados de valores.</li> <li>Identificar los recursos físicos, tecnológicos, financieros, de contratación y humanos que se requieran para el correcto funcionamiento del proceso.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Necesidad de contratación.</li> <li>Propuesta de inversión.</li> <li>Formato No. 351 de Valoración.</li> <li>Formato 468 de derivados.</li> <li>Valoración portafolio</li> <li>Cartas y formatos de confirmación.</li> <li>Formato Operaciones Cerradas (F267)</li> <li>Ticket de compra</li> <li>Documentos requieren ser archivados.</li> <li>Información para comunicar externamente.</li> <li>Información para comunicar internamente</li> <li>Información para publicar en página web, infoserivicio, SMS, email Marketing y asistente virtual.</li> <li>Requerimientos tecnológicos.</li> <li>Acciones correctivas.</li> <li>Cálculo de indicadores.</li> <li>Avance planes de acción.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Proceso precontractual</li> <li>Proceso Gestión de Riesgo de Mercado</li> <li>Superintendencia Financiera de Colombia.</li> <li>Proceso Gestión contable y tributaria</li> <li>Contrapartes</li> <li>Gestión de Riesgo de Mercado.</li> <li>Proceso Gestión de Pagos y Liquidez</li> <li>Proceso Gestión de archivo</li> <li>Proceso Gestión de Comunicación Externa.</li> <li>Proceso Gestión de Comunicación Organizacional.</li> <li>Proceso Gestión Comercial y de Mercadeo.</li> <li>Proceso Gestión de Servicios Tecnológicos.</li> <li>Proceso Evaluación Independiente.</li> <li>Proceso Planeación Estratégica</li> </ul>	
		<b>HACER</b>			<ul style="list-style-type: none"> <li>Elabora propuesta de inversión para el Comité Financiero y/o de Inversiones.</li> <li>Presenta propuesta de inversión al comité financiero y recibe autorización.</li> <li>Realiza la negociación de títulos valores.</li> <li>Registra compra, venta o redención del portafolio de inversiones en el sistema de administración de portafolios de inversión (SEVINPRO).</li> <li>Confirma y liquida en el sistema de administración de portafolios de inversión (SEVINPRO) la compra, venta y/o redención de títulos valores.</li> <li>Confirma la custodia de los títulos valores en el sistema del depósito centralizado de valores.</li> <li>Realiza valoración en el sistema de administración de portafolios de inversión (SEVINPRO).</li> <li>Transmite reportes de valoración a la Dirección de Contabilidad.</li> <li>Transmite reportes de valoración a la Superintendencia Financiera de Colombia (Portafolio TAE).</li> <li>Archiva y custodia los documentos del proceso.</li> </ul>
		<b>VERIFICAR</b>			<ul style="list-style-type: none"> <li>Verifica condiciones de negociación de los títulos valores.</li> <li>Verifica comportamiento y rendimiento de los portafolios de inversión.</li> <li>Verifica que las operaciones de inversiones</li> </ul>

PROVEEDORES	ENTRADAS	ACTIVIDADES	SALIDAS	CLIENTES
		<p>estén registradas en el sistema de administración de portafolios de inversión (SEVINPRO) y en el sistema financiero (APOTEOSYS).</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Concilia reportes generados por SEVINPRO con los extractos de los depósitos centralizados de valores.</li> </ul>		
		<p><b>ACTUAR</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Tener en cuenta las recomendaciones del comité financiero para la generación de las nuevas propuestas de inversión.</li> <li>Realiza ajustes de acuerdo con las conciliaciones realizadas.</li> <li>Realiza acciones correctivas y de mejora.</li> </ul>		

RECURSOS	REGISTROS GENERADOS	DOCUMENTOS RELACIONADOS	SEGUIMIENTO Y MEDICIÓN
<p><b>HUMANOS</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Analista de la Vicepresidencia Financiera.</li> <li>Comité Financiero y de Inversiones (integrantes: Jefe Oficina Asesora de Planeación, presidente, Secretario General, Vicepresidente Financiero).</li> <li>Director de Contabilidad.</li> <li>Director de Tesorería.</li> <li>Jefe de la Oficina de Riesgos.</li> <li>Técnico Administrativo de la Dirección de Tesorería.</li> <li>Analista de la Dirección de Tesorería.</li> <li>Vicepresidente Financiero.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li><a href="#">Listado Maestro de Registros</a></li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li><a href="#">Procedimiento Negociación de Inversiones.</a></li> <li><a href="#">Procedimiento Cumplimiento de operaciones de inversiones.</a></li> <li><a href="#">Procedimiento Conciliación portafolio de inversiones.</a></li> <li><a href="#">Procedimiento Valoración del portafolio de inversiones.</a></li> <li><a href="#">Procedimiento Gestión de Simultaneas.</a></li> <li><a href="#">Procedimiento Gestión de Forward.</a></li> <li><a href="#">Procedimiento Redención de Capital y/o Intereses de títulos Valores.</a></li> <li><a href="#">Manual de Inversiones</a></li> <li><a href="#">Guía Valoración de Portafolio de Inversiones.</a></li> <li><a href="#">Guía de reportes de portafolios eficientes black – litterman.</a></li> <li><a href="#">Guía Subastas cuentas abandonadas.</a></li> <li><a href="#">Autoevaluación del control.</a></li> <li><a href="#">Revisión por la dirección.</a></li> <li><a href="#">Generación y seguimiento de acuerdos de servicio.</a></li> <li><a href="#">Acciones Correctivas, preventivas y de mejora.</a></li> <li><a href="#">Control de documentos.</a></li> <li><a href="#">Presentación y aprobación de políticas y de estudios institucionales</a></li> <li><a href="#">Guía Metodología para desarrollar la encuesta autoevaluación del control.</a></li> <li><a href="#">Guía Metodología para el levantamiento de información.</a></li> <li><a href="#">Guía para la elaboración de documentos.</a></li> </ul>	<p><b>ESTRATÉGICO</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Rentabilidad portafolios de inversión</li> </ul>
<p><b>TECNOLÓGICOS</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Internet.</li> <li>Sistema Financiero "Apotheosys".</li> <li>Sistema de Administración de portafolios de inversión "SEVINPRO".</li> <li>Sistema del depósito centralizado "Deceval".</li> <li>Paquete Office.</li> <li>Sistema de "Bloomberg"</li> <li>Microsoft Excel</li> <li>Acceso a la superintendencia para enviar archivo de valoración del portafolio de inversiones.</li> <li>P á g i n a s Web:           <ul style="list-style-type: none"> <li><a href="http://www.bancorep.gov.co">www.bancorep.gov.co</a></li> <li><a href="http://www.infovalmer.com.c">www.infovalmer.com.c</a></li> </ul> </li> </ul>			
<p><b>INFRAESTRUCTURA</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Videobeam.</li> <li>Sala de juntas.</li> <li>Módulos de trabajo.</li> <li>Teléfono.</li> <li>Fax.</li> <li>Sistema de grabación telefónica.</li> </ul>			

RIESGOS ASOCIADOS	REQUISITOS APLICABLES
<ul style="list-style-type: none"> <li>Mapa Integral de Riesgos del Proceso Gestión de Inversiones. (<a href="#">Consulte el Mapa de Riesgo a través del aplicativo VIGIA.</a>)</li> </ul>	<p>LEGALES Y REGLAMENTARIOS</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><a href="#">Normograma</a></li> </ul>

RIESGOS ASOCIADOS MAPAS ESTRATÉGICOS	REQUISITOS APLICABLES
<ul style="list-style-type: none"> <li>• <a href="#">Mapa Estratégico Corporativo</a></li> <li>• <a href="#">Mapa Desdoblamiento Vicepresidencia Financiera</a></li> </ul>	NORMA ISO 9001:2015 <ul style="list-style-type: none"> <li>• 4.4 Sistema de Gestión de la Calidad y sus procesos</li> <li>• 5.3 Roles, responsabilidades y autoridades en la organización.</li> <li>• 6.1 Acciones para abordar riesgos y oportunidades</li> <li>• 7.1.1 Apoyo-Recursos-Generalidades</li> <li>• 7.1.6 Conocimientos de la organización</li> <li>• 7.5 Información documentada</li> <li>• 9.1.3 Análisis y evaluación</li> <li>• 9.3.2 Entradas de la revisión por la dirección</li> <li>• 10.2 No conformidad y Acción Correctiva</li> <li>• 10.3 Mejora continua</li> </ul>

COPIA CONTROLADA

## Modificaciones

### Descripción de cambios

- 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 actualizaron los hipervínculos.

### Historial de Versiones

Fecha Vigencia (Acto Adtvo)	Versión	Descripción de Cambios
2018-5-4	15	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Se alinearon los objetivos estratégicos e indicadores 2018.</li> <li>• Se alinearon los requisitos de la norma ISO 9001:2015.</li> <li>• Se modificaron salidas y entradas transversales.</li> <li>• Se modificaron el nombre de los procesos de Gestión de Servicios Tecnológicos, Administración de la Cartera, Gestión de comunicación externa, Gestión de comunicación organizacional.</li> <li>• Se actualizaron los hipervínculos.</li> </ul>
2017-5-16	14	De acuerdo con la Planeación Estratégica 2016-2020 y los nuevos mapas de desdoblamiento se realiza el ajuste para Objetivos e indicadores relacionados con el proceso.
2016-12-6	13	<p>-Se elimina la entrada que tenía como proveedor al proceso de gestión de riesgo liquidez, con el Informe de VaR, Prestenación y acta Comité CAP, Informe de riesgo de liquidez</p> <p>-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</p> <p>- Se modifica la salida Estudio previo de conveniencia y oportunidad por Necesidad de contratación con el mismo cliente</p>
2015-07-27	12	<p>-Se ajustaron los Proveedores - Entradas ; Salidas - Clientes .</p> <p>-En el módulo de Seguimiento y Medición se eliminó el Indicador Estratégico " Rentabilidad de los portafolios" y se agregaron los indicadores "Rentabilidad de los portafolios propios" y "Rentabilidad de recursos de terceros"</p>
2015-1-30	11	<p>Se eliminan los registros relacionados y se crea vínculo al Listado Maestro de Registros</p> <p>Se elimina el listado de Requisitos aplicables - Legales y reglamentarios y se crea vínculo del Normograma.</p>
2014-04-03	10	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Objetivos: Se ingresa el nuevo objetivo estratégico alineado al proceso.</li> <li>• Seguimiento y Medición: Se ingresa el indicador asociado al objetivo estratégico.</li> <li>• Documentos y registros relacionados: Se revisaron los documentos relacionados y sus hipervínculos.</li> </ul>
2013-06-07	9	Se incluye el acuerdo 038 dentro de las normas legales y reglamentarios.

2013-05-23	8	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.
2012-09-24	7	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.
2012-5-18	6	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Actulización en los registros generados.</li> <li>• Inclusion delCodigo de Etica y Buen gobierno del ICETEX</li> </ul>
2012-5-15	5	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Ajuste en la caracterizacion, entradas ciclo PHVA y salidas.</li> <li>• Cambio en los registros generados</li> </ul>
2012-3-7	4	<p>Se ajusta el objetivo de acuerdo al Objetivo estrategico</p> <p>Se adiciona un recurso tecnologico</p> <p>Cambio en el lider del proceso</p>
02/03/2011	3	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 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.</li> <li>• Se agregaron los numerales de la norma NTCGP 1000:2009 e ISO 9001:2008: <ul style="list-style-type: none"> <li>◦ 4.1 Requisitos Generales</li> <li>◦ 4.2.3 Control de documentos</li> <li>◦ 4.2.4 Control de Registros</li> <li>◦ 5.6.2 Información para la Revisión</li> <li>◦ 8.2.3 Seguimiento y Medición de los procesos</li> <li>◦ 8.5.1 Mejora Continua</li> <li>◦ 8.5.2 Acciones Correctivas</li> <li>◦ 8.5.3 Acciones preventivas</li> </ul> </li> </ul>
-	2.0	-
-	1.0	-