

INFORME SOBRE EL SISTEMA DE ADMINISTRACIÓN DEL RIESGO OPERATIVO - SARO PRIMER SEMESTRE 2020

Durante el primer semestre del año, Derivex desarrolló las actividades correspondientes para una adecuada administración del Riesgo Operativo, con base en las buenas prácticas para la gestión y monitoreo de dicho riesgo que se resume en los siguientes lineamientos:

1. La Junta Directiva de la Compañía fue informada, en febrero del presente año, respecto al informe correspondiente al II semestre del 2019.
2. El Gerente General realizó el seguimiento a las instrucciones impartidas e informó a la Junta Directiva, en febrero del presente año, la gestión realizada durante el 2019.
3. En el mes de febrero el Gestor de Riesgos reportó al Gerente General la gestión realizada en el 2019, respecto a la evolución del riesgo, los controles implementados y el monitoreo que se realizó sobre el mismo. Así mismo, ha coordinado la consolidación de la información para alimentar el registro de eventos de riesgo operativo con el fin de administrar el registro de eventos.
4. Los dueños de proceso aplicaron una correcta gestión de riesgos en los procesos en los cuales son responsables. Así mismo, reportaron oportunamente las situaciones críticas y que de cierta manera pudieran llegar a afectar en funcionamiento normal de la operación.

La Compañía dispone de los componentes que le permiten llevar a cabo una adecuada Administración del Riesgo Operativo:

1. Plan de continuidad del negocio para mantener la continuidad de funciones críticas de negocio, ante amenazas que puedan ocasionar interrupciones e impactos financieros, legales, reputacionales, entre otros.
2. Estructura Organizacional compuesta por la Junta Directiva, Representante Legal, Gestor de Riesgos y dueños de procesos.
3. Matriz de riesgo operativo
4. Matriz de eventos de riesgo operativo

Riesgos por procesos

A continuación, se presentan los riesgos por procesos de la Compañía:

Proceso	No. de Riesgos a 30 de junio de 2020
Gestión de la información	9
Administración del mercado	8
Gestión de control interno	5
Gestión de la estrategia empresarial	4
Facturación y recaudo	4
Gestión contable	4
Gestión del talento humano	3
Gestión de proveedores	3
Valoración de precios	2
Gestión de la estrategia comercial del mercado	2
Gestión del mejoramiento continuo	2
Gestión de vinculación, mantenimiento de clientes y otros servicios	1
Total	47

Riesgo Inherente

Clasificación	No. de Riesgos a 30 de junio de 2020	Porcentaje %
Tolerable	21	45%
Inaceptable	8	17%
Grave	12	26%
Aceptable	6	13%
Total	47	100%

Una vez establecido el riesgo inherente se aplica la metodología para calcular el riesgo residual, entendiendo este como el nivel resultante del riesgo después de aplicar los controles, obteniendo así la conformación del riesgo residual.

El perfil de riesgo de la Compañía se expresa a nivel residual, se mantiene en la categoría aceptable, registrando al cierre del semestre, un total de 47 riesgos, de los cuales treinta y tres (33) son Aceptables, catorce (14) son Tolerables.

Riesgo Residual

Clasificación	No. de Riesgos a 30 de junio de 2020	Porcentaje %
Aceptable	33	70%
Tolerable	14	30%
Grave	0	0%
Inaceptable	0	0%
Total	47	100%

Registro de Eventos de Riesgo Operativo

Durante el primer semestre de 2020, se detectó un evento de riesgo operativo, este riesgo no generó pérdidas o afectación a los Estados Financieros, sin embargo, se realizó la gestión para subsanar el evento y así evitar que se presente en el futuro.

En el mes de marzo, se presentaron dificultades técnicas en la plataforma tecnológica lo cual afectó la apertura del mercado, como plan de acción se emitieron los respectivos boletines informativos, con el instructivo operativo para dar continuidad a la operación, y además, conservar la relación de confianza con los clientes y mitigar el riesgo reputacional del negocio. Adicional, la bvc, como proveedor tecnológico de la Compañía, informó las causas y los controles implementados para evitar su ocurrencia.

Por otro lado, la Compañía centró sus esfuerzos en la revisión, análisis y actualización de los procedimientos de la Organización. Finalmente, se tiene previsto realizar la capacitación anual

a toda la organización durante el segundo semestre del año. En todo caso, durante el primer semestre del 2020, se llevó a cabo la capacitación de inducción al nuevo personal vinculado a la entidad durante el periodo antes mencionado. Con el fin de otorgar la información relativa al Sistema de Riesgo Operativo de la Compañía, para su correcta aplicación.

Plan de continuidad del negocio

En atención a las recomendaciones preventivas y de autocuidado emitidas por las autoridades del Estado respecto al COVID-19, a partir del 24 de marzo del presente año, el 100% de los colaboradores han permanecido en modalidad de trabajo remoto, de manera transitoria, a través del aprovechamiento de los recursos tecnológicos, con el fin de garantizar la continuidad operativa de la Compañía. Es así como en este mismo mes la Junta Directiva aprobó la política de trabajo en casa, como medida de carácter temporal, acatando la medida de aislamiento preventivo obligatorio, en el mencionado documento se describieron las medidas específicas de seguridad de la información y ciberseguridad que deben cumplir todos los miembros de la comunidad del grupo empresarial que requieran conexión remota. La política fue socializada a todo el personal de la compañía para su estricto cumplimiento junto con información de recomendaciones en temas de ciberseguridad.

Por otro lado, de acuerdo con el plan de continuidad del negocio, que entre otras cosas establece realizar pruebas mensuales en el Centro Alterno de Operaciones (CAO), se desarrollaron con normalidad las pruebas respectivas, por medio de conexión remota, a partir del mes de abril, dada la contingencia de salud pública, en las que se validó el tiempo de conexión y el funcionamiento al equipo de cómputo del Centro Alterno de Operaciones (CAO), la disponibilidad de los programas necesarios para el correcto funcionamiento de la operación, y finalmente, el resultado de dichas pruebas se registró en el *“formato visita CAO”*.

En la siguiente tabla se resume el resultado de las pruebas realizadas en el CAO durante el primer semestre de 2020:

DERIVEX S.A.

RESUMEN PRUEBAS CAO I SEMESTRE 2020

SOFTWARE Y ACCESOS QUE DEBEN ESTAR HABILITADOS							
	Concepto	ene	feb	mar	abr	may	jun
SOFTWARE	Microsoft Office Excel	ok	ok		ok	x	ok
	Microsoft Office Word	ok	ok		ok	x	ok
	Microsoft Office Power Point	ok	ok		ok	x	ok
	Microsoft Outlook	ok	ok		ok	x	ok
	X - Stream	ok	ok		ok	x	ok
	Internet Explorer	ok	ok		ok	ok	ok
	Adobe Reader	ok	ok		ok	ok	ok
	Certicámara Toquen	ok	ok		ok	ok	ok
ACCESOS	Disco S:\	ok	ok		ok	ok	ok
	Acceso a Internet	ok	ok		ok	ok	ok
	Acceso al correo electronico	ok	ok		ok	x	ok
	Acceso a X - Stream	ok	ok		ok	x	ok
	Certicámara	ok	ok		ok	ok	ok
	Equipo telefónico	ok	ok		NA	NA	NA
Observaciones							
La visita correspondiente al mes de marzo estaba programada para el 26 de marzo de 2020, sin embargo, teniendo en cuenta las medidas de prevención y de autocuidado emitidas por las autoridades del Estado respecto COVID-19, la visita se canceló.							
Debido a la situación especial de salud pública, se realizaron las pruebas para los meses de abril a junio, por medio de conexión remota al equipo de cómputo del CAO, por lo que no se hace validación del equipo telefónico							
Los inconvenientes presentados en el mes de mayo fueron reportados al área de Servicios al Cliente y de Soporte de bvc, los cuales fueron solucionados y validados. Las pruebas realizadas en junio fueron exitosas							

Con el objetivo de Identificar los riesgos operativos a los que puede exponerse la Compañía, se tiene previsto llevar a cabo, en el segundo semestre del año, las pruebas de recorrido principalmente en los procesos críticos para la continuidad del negocio como son: Administración del Mercado, gestión de información y valoración de precios. A continuación, se presenta el cronograma correspondiente:



MERCADO DE DERIVADOS DE COMMODITIES ENERGÉTICOS

DERIVEX S.A.

PLAN DE PRUEBAS II SEMESTRE 2020

CRONOGRAMA	jul	ago	sep	oct	nov	dic
Pruebas CAO						
Pruebas de recorrdio proceso Gestión de la inforación						
Pruebas de recorrdio proceso Valoración de precios						
Pruebas de recorrdio Administración del mercado (INET)*						

*según cronograma de pruebas de nuestro proveedor tecnológico (bvc)