

## TABLA DE CONTENIDO

1.	Antecedentes generales .....	1
1.1.	Características de la organización .....	1
1.2.	Marco institucional .....	1
1.2.1.	Actores .....	1
1.2.2.	Relaciones .....	2
1.2.3.	Regulaciones relevantes .....	3
1.3.	Desempeño organizacional .....	3
2.	Justificación del tema .....	4
2.1.	Información del área de la organización .....	4
2.2.	Identificación del problema a resolver.....	5
2.3.	Hipótesis y posibles alternativas de solución .....	6
2.4.	Impacto del cambio propuesto .....	6
3.	Objetivos.....	7
3.1.	Objetivo general.....	7
3.2.	Objetivos específicos .....	7
4.	Marco Conceptual .....	7
4.1.	Definición de proceso .....	7
4.2.	Identificación de áreas funcionales de la administración de fondos.....	8
4.3.	Definición e identificación de riesgos en las áreas funcionales .....	8
4.4.	Gestión de riesgos .....	10
5.	Metodología.....	10
5.1.	Diseño del proceso .....	10
5.2.	Gestión de riesgos .....	11
6.	Desarrollo del trabajo.....	13
6.1.	Revisión normativa .....	13
6.1.1.	Procedimiento de control y gestión de envío.....	14
6.1.2.	Procedimiento de ingreso de tareas a Outlook .....	15
6.1.3.	Procedimiento de actualización y cierre de tareas en Outlook.....	17
6.2.	Diseño del proceso de aportes y rescates .....	18
6.2.1.	Proceso de aportes .....	18
6.2.2.	Proceso de rescates .....	24
6.3.	Gestión de Riesgos.....	28

6.3.1. Identificación de riesgos.....	28
6.3.2. Tratamiento del Riesgo .....	36
6.3.3. Monitoreo y Revisión.....	40
7. Conclusiones y recomendaciones .....	40
8. Bibliografía.....	42
9. Anexos.....	43

## ÍNDICE DE ILUSTRACIONES

Ilustración 1. Evolución del valor cuota del fondo administrado por Vantrust Capital AGF desde el 04/07/19 al 31/03/20. Fuente: CMF .....	4
Ilustración 2. Organigrama Vantrust Capital Administradora General de Fondos S.A. Fuente: Elaboración propia. ....	5
Ilustración 3. Esquema para la organización de las fases de la gestión de riesgo. Fuente: CAIGG.....	13
Ilustración 4. Diagrama del proceso de aportes a un fondo determinado dentro de la Administradora. Fuente: Elaboración propia. ....	22
Ilustración 5. Diagrama del subproceso "Cerrar el fondo" dentro del proceso de aportes. Fuente: Elaboración propia. ....	23
Ilustración 6. Diagrama del proceso de rescates a un fondo determinado dentro de la Administradora. Fuente: Elaboración propia. ....	26
Ilustración 7. Diagrama del subproceso "Cerrar el fondo" dentro del proceso de rescates. Fuente: Elaboración propia. ....	27
Ilustración 8. Matriz de Riesgo definida por Vantrust Capital holding. Fuente: Elaboración propia. ....	34
Ilustración 9. Matriz de riesgo inherente del proceso de aportes y rescates. Fuente: Elaboración propia. ....	36
Ilustración 10. Matriz de riesgo residual del proceso de aportes y rescates. Fuente: Elaboración propia. ....	40