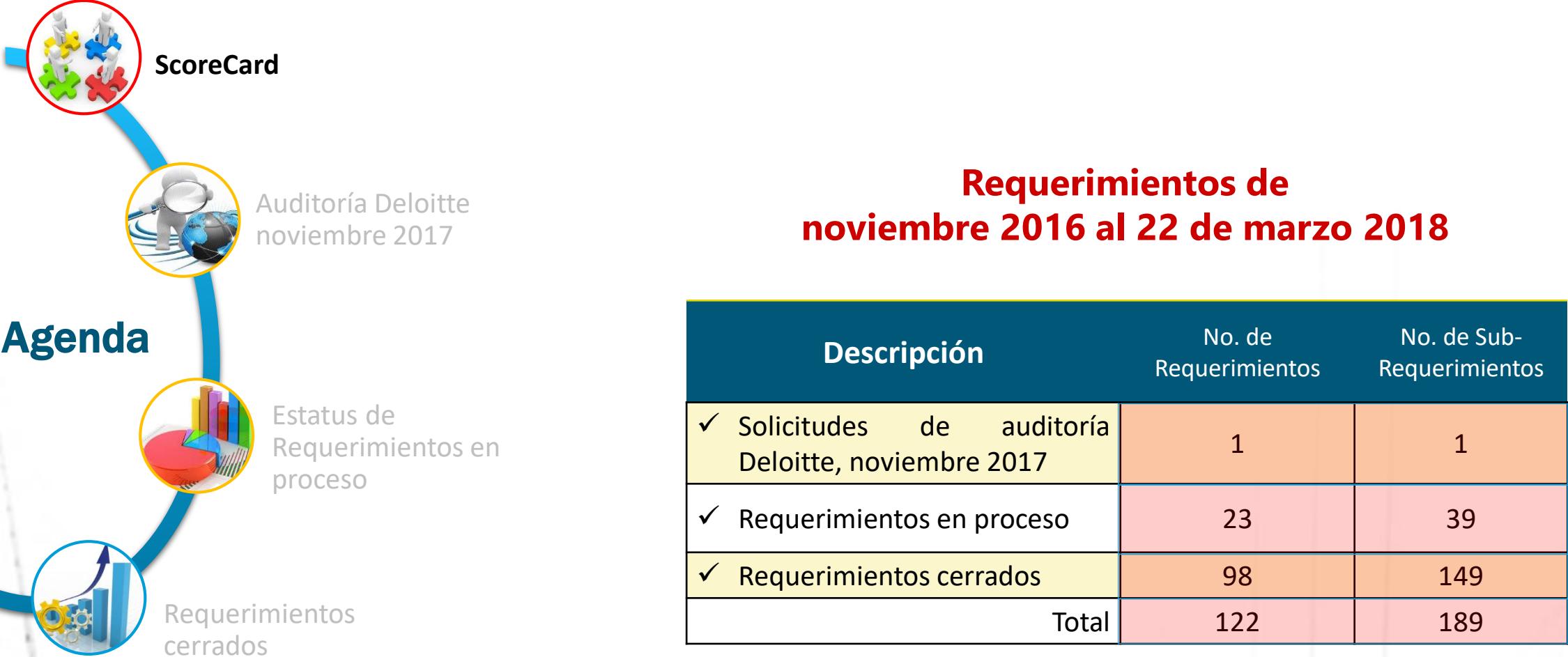


Seguimiento a requerimientos de Mercados Financieros



23 de marzo, 2018







Auditoría Deloitte noviembre 2017

No	Hallazgo	Acciones	%Plan vs %Comp.	Fecha Inicial/final	Responsables
1	Valuación Periódica y análisis Prudencial 620	8. Que se realice una evaluación y valuación de los proyectos que integran el pipeline de los instrumentos estructurados.- De acuerdo a la reunión del martes 13 de marzo, se estableció que se generará el proceso de la Evaluación, para el tema de Valuación se elaboró la fundamentación del porque no es posible realizarse.	64% vs 23%	15-dic-18 21-05-18	Irving González



ScoreCard

Auditoría Deloitte
noviembre 2017

Agenda

Estatus de
Requerimientos en
proceso

Requerimientos
cerrados

Estatus de requerimientos en proceso



Requerimientos en proceso

No	Requerimiento	Acciones	Fecha Inicial /final	Responsable
1	Portal de CKD's CHG0030246	<ul style="list-style-type: none"> Reporte de ocupación por sector de CKD's.- Se finalizó la fase de análisis y la próxima semana, se inicia con el desarrollo. INC0170869 	26-mar-18/ 27-abr-18	René Arroyo
2	Portal de Fibras	<ul style="list-style-type: none"> Agregar el cuestionario de Fibras E.- El 16 de marzo se liberó el cuestionario en el ambiente de producción. (Nuevo) 	Cerrado	René Arroyo/ Cesar Villanueva
3	Seguimiento de Fibras INC0170695	<ul style="list-style-type: none"> Ver análisis completo diapositiva 12, el porcentaje general de avance es del 100%. 	Cerrado	Irving González/ César Villanueva
4	Seguimiento Trimestral	<ul style="list-style-type: none"> CKD's .- Este requerimiento es dependiente de la información que se consiga de los CKD's y está relacionado al punto 620-8 de la Auditoría de Deloitte (INC0170650), se homologa con el requerimiento (INC0170850) Análisis Trimestral de CKD's. 	Seguimiento	Irving González/ Fernanda Godínez
		<ul style="list-style-type: none"> Corporativos.- A la fecha se ha realizado el seguimiento con la información publicada en S&P, el avance está disponible en el "Directorio Bloomberg". INC0170852 		Irving González
5	Resumen sobre actualizaciones Trimestrales (Nuevo)	<ul style="list-style-type: none"> Se compartió por parte del Infonavit el formato ejemplo para realizar el comparativo de la información trimestral de emisoras que están en cartera, el requerimiento se encuentra en fase de análisis. 	Por definir	Irving González
6	Rendimientos a 1, 3 y 5 años INC0180148	<ul style="list-style-type: none"> Generar los rendimientos a corto, mediano y largo plazo.- Se compartió el archivo con la información de rendimientos a largo plazo, en espera de retroalimentación de parte del Infonavit. 	16-feb-18/ 4-may-18	Irving González/ Enrique Trueba
7	Optimización de Clases de activo INC0180149	<ul style="list-style-type: none"> Pendiente de confirmar a Irving González con que expectativas e instrumentos, se ejecutarán las optimizaciones de clases de activo, dependiente del punto anterior (6). 	Por definir	Irving González
8	Análisis del Aeropuerto (Nuevo INC0180160)	<ul style="list-style-type: none"> El análisis fue enviado el 18 de marzo al Infonavit, queda pendiente que se defina, si el análisis es requerido en algún formato en específico. 	Seguimiento	Homero Elizondo
9	Análisis de crédito corporativo de Banca de Desarrollo INC0180147	<ul style="list-style-type: none"> El plan de trabajo va de acuerdo a lo planeado. 	2-feb-18/ 20-abr-18	Irving González



Requerimientos en proceso

No	Requerimiento	Acciones	Fecha Inicial /final	Responsable
10	Directorio de contactos de emisoras en posición INC0170898	<ul style="list-style-type: none"> El requerimiento ya fue finalizado, la información se encuentra disponible en el “Directorio Bloomberg”. 	Cerrado	Irving González
11	Gráficas de Análisis Corporativo INC0180013	<ul style="list-style-type: none"> Agregar Gráficas en la Plataforma Tecnológica de los Corporativos Analizados.- El 16 de marzo se finalizaron las pruebas internas y se está trabajando con los ajustes solicitados por parte de Irving González. 	11-ene-18/ 16-mar-18 02-abr-18	René Arroyo
12	Generación de procesos para la toma de decisiones de clases de activos	<p>Análisis de ETF's:</p> <ul style="list-style-type: none"> Se está revisando si Amafore se da de alta como proveedor en el Infonavit. Se debe de considerar la incorporación de ETF's en el manual de inversiones, pendiente definir la fecha para llevar acabo la reunión de elaboración del Macro proceso de inversión. <p>Análisis de CERPIS.- Se realizarán los análisis sobre pedido.</p>	Por definir	Irving González/ Enrique Trueba
		Fase 2.-Se está desarrollando un monitor para el análisis de acciones individuales de México. INC0180136	Por definir	
13	Análisis Europa INC0180146	<ul style="list-style-type: none"> Análisis sobre la región de Europa, debido a la exposición que tiene el Infonavit a esta región vía equity y bonos bancarios estructurados, una nota de importancia es la que esta referencia a Salud Europa. - Se entregó la primera versión el 9 de marzo y se está trabajando con los ajustes solicitados. 	4-may-18	Irving González
14	Análisis de propuestas de los candidatos a la presidencia (Nuevo)	<ul style="list-style-type: none"> El requerimiento está en fase de análisis, se estima finalizar el 20 de abril. 	20-abr-18	Irving González
15	Implementación de derivados INC0170760	<ul style="list-style-type: none"> Está pendiente el Vo.Bo de las pruebas de aceptación que se realizaron durante el 2017. Está pendiente que el área de Contabilidad defina el cambio que requiere en el método de valuación de los derivados. Pendiente la selección del proveedor que realizará la validación del proceso de punta a punta, se continua en revisión de los costos. 	09-feb-17/ Seguimiento	Eric Arteaga



Requerimientos en proceso

No	Requerimiento	Acciones	Fecha Inicial /final	Responsable
16	Nuevos fondos	<ul style="list-style-type: none"> • Fondo FPP.- Se requiere que al menos el Infonavit de aviso de manera formal de que el fondo va a operar con una semana de anticipación. CHG0370039 • Fondo CONDE.- Se requiere que al menos el Infonavit de aviso de manera formal de que el fondo va a operar con una semana de anticipación, es importante considerar que se debe de definir: Aportación Inicial, Política de Gastos y Catálogo de equivalencia en caso que sea diferente al de FANVIT1. CHG0370149 • Fondo FOAH.- Pendiente de definición de las actividades a realizar. CHG0370124 • Fondo FJP.- Pendiente de definición de las actividades a realizar. CHG0370150 • Archivo de cuentas para nuevos fondos. (Nuevo) 	Seguimiento Seguimiento Por definir Por definir 13-abr-18	René Arroyo/ Luis Serdio René Arroyo/ Juan José Sánchez
17	Modificar los límites de riesgos y reglas de cumplimiento en CRIMS INC0170820	<ul style="list-style-type: none"> • Modificar los límites de riesgos y reglas de cumplimiento en CRIMS.- En espera de iniciar las pruebas de aceptación, este requerimiento es dependiente a los ajustes adicionales solicitados y descritos en los siguientes puntos. INC0170820 • Agregar funcionalidad del Pledge “Pignorados”.- Se liberó el 13 de marzo, en proceso de validar si la fecha considerada es la de llamada de Capital o la de vencimiento del Instrumento. INC0180132 • Estado de cuenta de Pignorados.- Se liberó el 13 de marzo. INC0180153 • Identificación de Quirografarios.- Se están corrigiendo los errores detectados en la lista de Quirografarios. INC0180152 • Cálculo de los títulos en Circulación.- Se detectó que en algunos casos se requieren cálculos adicionales en los instrumentos, ya se tiene definido el esfuerzo para realizar los ajustes. 	Seguimiento Cerrado Cerrado Seguimiento 6-abr-18	Alfredo García René Arroyo/ Alfredo García



Requerimientos en proceso

No	Requerimiento	Acciones	Fecha Inicial /final	Responsable
18	Temas de Auditoría 	<ul style="list-style-type: none">Desarrollar el proceso de revisión de documentación de la mejor ejecución.- En espera de que se finalice la Mejor ejecución en CRIMS. CHG0370096-Infonavit		Alfredo García
19	Mejora en los procesos automáticos del custodio Bancomer       	Primera Fase		
		<ul style="list-style-type: none">Transferencia de fondos “Instrucción de efectivo”.- Se finalizaron las pruebas de aceptación y se definió que la fecha de liberación en producción será el 6 de abril. INC0180050	06-abr-18	René Arroyo/ Fernando Tarango
		<ul style="list-style-type: none">Estatus de operaciones.- Se finalizaron las pruebas de aceptación y se definió que la fecha de liberación en producción será el 6 de abril. INC0180051	06-abr-18	
		<ul style="list-style-type: none">Autorización de operaciones.- En proceso de desarrollo, está pendiente que Bancomer determine la fecha de finalización. INC0180052	06-abr-18 	
		Segunda Fase		
		<ul style="list-style-type: none">Estado de cuenta. INC0180053		
		<ul style="list-style-type: none">Reporte de movimientos y recepción de fondos. INC0180054		
		<ul style="list-style-type: none">Descarga automática de información de la cartera liquidada para el envío de la información al área de Análisis Prudencial (Archivo Indeval y Eventos Corporativos). INC0170696		
20	Due Diligence Sistema de administración de inversiones CHG0370157 	<ul style="list-style-type: none">Se estima iniciar con el proyecto en el primer trimestre del 2018, en espera de retroalimentación del análisis de costos y funcionalidad entre CRIMS y BlackRock.		Enrique Trueba/ José Luis R. Grimaldo
21	Segundo Curso AMIB Figura 3 INC0180150 	<ul style="list-style-type: none">Todos los participantes ya cuentan con su documentación, solo faltaría que algunos participantes tomen el curso de ética.		Denise Rodríguez/ Enrique Parra



Requerimientos en proceso

No	Requerimiento	Acciones	Fecha Inicial /final	Responsable
22	Adaptación del Video Wall para proyectar canales de video INC0180048 ➔	<ul style="list-style-type: none">El día 24 de marzo se realizarán pruebas para proyectar canales de video.	Seguimiento	Enrique Parra
23	Mejoras en los entregables INC0180083 ➔	<p>Este requerimiento es resultado de la revisión de los entregables del último trimestre del 2017: Porcentaje de avance 81% vs 81%.</p> <ul style="list-style-type: none">Siguientes pasos:<ol style="list-style-type: none">- Recabar con Eric Arteaga las adecuaciones que requiere en el Reporte de calculadora P&L bonos.- Firma de la evidencia por parte de Alfredo García en la incorporación del reporte de Riesgo operativo en la Plataforma Tecnológica.	15-ene-18/ 12-jun-18	Eduardo Elizondo/ Irving González/ Rosario Juárez/ René Arroyo



Requerimientos en proceso

No	Requerimiento	Acciones	Fecha Inicial /final	Responsable									
5	Generación de procesos para la toma de decisiones de clases de activos 	<p>Análisis de Fibras INC0170695</p> <ul style="list-style-type: none"> Porcentaje general de avance 100% <p>✓ Total de Fibras 7*</p> <p>*Fibras (6) y Sobre pedido, Fibra E (1)</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding: 5px;">✓ Total de Fibras con Documentación (Analizados)</td> <td style="padding: 5px; text-align: center;">7</td> <td style="background-color: #80E6AA; width: 20px;"></td> </tr> <tr> <td style="padding: 5px;">✓ Total de Fibras en fase de Análisis de bases de datos (En proceso)</td> <td style="padding: 5px; text-align: center;">-</td> <td style="background-color: #FFFF99; width: 20px;"></td> </tr> <tr> <td style="padding: 5px;">✓ Total de Fibras por obtener base de datos (En tránsito)</td> <td style="padding: 5px; text-align: center;">-</td> <td style="background-color: #FFA500; width: 20px;"></td> </tr> </table> 	✓ Total de Fibras con Documentación (Analizados)	7		✓ Total de Fibras en fase de Análisis de bases de datos (En proceso)	-		✓ Total de Fibras por obtener base de datos (En tránsito)	-		Seguimiento	Irving González
✓ Total de Fibras con Documentación (Analizados)	7												
✓ Total de Fibras en fase de Análisis de bases de datos (En proceso)	-												
✓ Total de Fibras por obtener base de datos (En tránsito)	-												

1) Base de Datos
(En tránsito)

2) Análisis de la Bases de Datos
(En proceso)

3) Documentación
(Analizados)

Proceso



Requerimientos en proceso

No	Requerimiento	Acciones																													
5	Generación de procesos para la toma de decisiones de clases de activos	<p style="text-align: center;">Estatus por Sector</p> <p style="text-align: center;">Certificados Bursátiles Fiduciarios Inmobiliarios (CF)</p> <table border="1"><thead><tr><th>Sector</th><th>Con documentación (Analizados)</th><th>Análisis de bases de datos (En proceso)</th><th>Por obtener base de datos (En tránsito)</th><th>Totales</th></tr></thead><tbody><tr><td>1 Mixto</td><td>3</td><td>-</td><td>-</td><td>3</td></tr><tr><td>2 Industrial</td><td>3</td><td>-</td><td>-</td><td>3</td></tr><tr><td>3 Energía</td><td>1</td><td>-</td><td>-</td><td>1</td></tr><tr><td>Total</td><td>7</td><td>-</td><td>-</td><td>7</td></tr></tbody></table>					Sector	Con documentación (Analizados)	Análisis de bases de datos (En proceso)	Por obtener base de datos (En tránsito)	Totales	1 Mixto	3	-	-	3	2 Industrial	3	-	-	3	3 Energía	1	-	-	1	Total	7	-	-	7
Sector	Con documentación (Analizados)	Análisis de bases de datos (En proceso)	Por obtener base de datos (En tránsito)	Totales																											
1 Mixto	3	-	-	3																											
2 Industrial	3	-	-	3																											
3 Energía	1	-	-	1																											
Total	7	-	-	7																											

1) Base de Datos
(En tránsito)

2) Análisis de la Bases de Datos
(En proceso)

3) Documentación
(Analizados)

Proceso



Requerimientos en proceso

No	Requerimiento	Acciones																																													
5	Generación de procesos para la toma de decisiones de clases de activos	<p style="text-align: center;">Porcentaje de avance de análisis de Fibras por sector</p> <table border="1"><thead><tr><th rowspan="2">Sector</th><th colspan="2">CF*</th><th colspan="2">Fibras Sobre pedido</th><th colspan="2">Totales</th></tr><tr><th>No. de Fibras</th><th>% de Avance</th><th>No. de Fibras</th><th>% de Avance</th><th>No. de Fibras</th><th>% de Avance</th></tr></thead><tbody><tr><td>1 Mixto</td><td>3</td><td>100%</td><td>-</td><td>-</td><td>3</td><td>100%</td></tr><tr><td>2 Industrial</td><td>3</td><td>100%</td><td>-</td><td>-</td><td>3</td><td>100%</td></tr><tr><td>3 Energía</td><td></td><td></td><td>1</td><td>100%</td><td>1</td><td>100%</td></tr><tr><td>Total</td><td>6</td><td>100%</td><td>1</td><td>100%</td><td>7</td><td>100%</td></tr></tbody></table>					Sector	CF*		Fibras Sobre pedido		Totales		No. de Fibras	% de Avance	No. de Fibras	% de Avance	No. de Fibras	% de Avance	1 Mixto	3	100%	-	-	3	100%	2 Industrial	3	100%	-	-	3	100%	3 Energía			1	100%	1	100%	Total	6	100%	1	100%	7	100%
Sector	CF*		Fibras Sobre pedido		Totales																																										
	No. de Fibras	% de Avance	No. de Fibras	% de Avance	No. de Fibras	% de Avance																																									
1 Mixto	3	100%	-	-	3	100%																																									
2 Industrial	3	100%	-	-	3	100%																																									
3 Energía			1	100%	1	100%																																									
Total	6	100%	1	100%	7	100%																																									
<p>* Certificados Bursátiles Fiduciarios Inmobiliarios.</p>																																															

1) Base de Datos
(En tránsito)

2) Análisis de la Bases de Datos
(En proceso)

3) Documentación
(Analizados)



Agenda

Requerimientos cerrados

Requerimientos cerrados

Estatus de
Requerimientos en
proceso

Auditoría Deloitte
noviembre 2017



ScoreCard



Requerimientos cerrados (18)

No	Requerimiento	No. Ticket	Sub- Requerimiento	Fecha de cierre
1	Portal de CKD's	CHG0030246	Obtención de la retroalimentación de otros clientes sobre la experiencia que tuvieron con el portal de Afore XXI	09/12/2016
		CHG0030246	Proceso de precalificación de los CKD's.	09/12/2016
		CHG0030246	Sección que incluya los antecedentes, la misión, la visión, valores y diagrama de flujo del proceso de la solicitud	09/12/2016
		CHG0030246	Liberación del Portal de CKD's	18/01/2017
		CHG0030246	Incluir el objetivo del portal de CKD's en el Landing Page y compartir usuario de pruebas a Fernanda Godinez.	27/01/2017
		CHG0030246	Funcionalidad "Sitio en construcción", para la sección del Landing Page	03/02/2017
		CHG0030246	Funcionalidad de Incluir el cuestionario de la Debida Diligencia en el portal.	16/02/2017
		CHG0030246	Funcionalidad de Ampliar el tamaño a 5, 000 caracteres en los campos de las respuestas	16/02/2017
		CHG0030246	Reporte en Excel para visualizar la información capturada por los CKD's.	16/02/2017
		CHG0030246	Publicación del video del proceso de evaluación del CKD, se realizará una vez que sea publico el portal de CKD's.	16/02/2017
		INC0170092	Guía rápida en el uso del Portal para el perfil de administrador y de CKD.	24/02/2017
		CHG0370058	Carga Inicial de la información CKD's en el portal	03/03/2017
		CHG0370042	Funcionalidad de descarga de los archivos de los CKD's por medio del portal	03/03/2017
		CHG0370050	Funcionalidad de Descarga de la guía rápida desde el portal de CKD's.	03/03/2017
		CHG0370060	Alta de usuarios del Portal de CKD's	10/03/2017
		CHG0370043	Funcionalidad de Seguimiento a los CKD's para actualizar información cada 3 meses	22/03/2017
		CHG0370072	Funcionalidad que permita tener el registro de los usuarios, que ya revisaron la información cargada por los CKD's.	18/04/2017
		CHG0370044	Reporte consolidado de la información capturada por los CKD's.	26/04/2017



Requerimientos cerrados (14)

No	Requerimiento	No. Ticket	Sub- Requerimiento	Fecha de cierre
1	Portal de CKD's	CHG0370122	El 1 de junio se liberó, la funcionalidad de notificación a usuarios y confirmación de parte del área de Legal.	1/06/2017
		CHG0370147	El 5 de junio se liberó la funcionalidad de actualización de los documentos de los CKD's.,	5/06/2017
		INC0170504	Enviar un correo al área de Legal, con el listado de los CKD's que están pendientes de liberar.	5/06/2017
		CHG0370164	Se liberó el 15 de junio la corrección a la impresión del formato de PDF del formulario de CKD's.	15/06/2017
		CHG0370165	Funcionalidad de tipo de usuario Colocador y Emisor, se liberó el 5 de julio.	5/07/2017
		INC0170522	Agregar un campo al cuestionario de CKD's denominado Hombres Clave, se liberó el 5 de julio.	5/07/2017
		INC0170563	Agregar un Campo de precalificación del CKD, se liberó el 5 de julio, actividad en adelanto.	5/07/2017
		INC0170699	Formato para el análisis trimestral de CKD's.- Ya se definió el formato a utilizar	25/08/2017
		CHG0370061-Infonavit	Establecer un proceso de control a la alta y evaluación de CKD's.	8/09/2017
		CHG0370155	Seguimiento Trimestral de CKD's en la plataforma tecnológica.- La funcionalidad se liberó el 23 de octubre	23/11/2017
		INC0170505	Pasar a cualquier estado del CKD y envió de recordatorios de tarea de manera manual.- La funcionalidad se liberó el 23 de octubre.	23/11/2017
		CHG0370121	Módulo de Administración usuarios "Reporte con el listado de los usuarios que tienen atributos dentro del portal de CKD's".- La funcionalidad se liberó el 23 de octubre.	23/11/2017
		INC0170709	Incorporar funcionalidad que permita que un externo al Infonavit tenga acceso a la información de los CKD's.- La funcionalidad se liberó el 23 de octubre.	23/11/2017
		INC0170776	Agregar un nuevo campo en el formulario de inicio, el campo se debe de llamar "Estructurador". La funcionalidad se liberó el 23 de octubre.	23/11/2017



Requerimientos cerrados (4)

No	Requerimiento	No. Ticket	Sub- Requerimiento	Fecha de cierre
1	Portal de CKD's	INC0170849	<ul style="list-style-type: none">Puntos de mejora.- Los ajustes se liberaron el 27 de noviembre.1.- En el alta de usuario permitir la elección de estructurador.2.- Relacionar cada CKD con administrador, colocador y estructurador.3.- Disparar notificaciones automáticas y manuales al revisor Jurídico.	27/11/17
		CHG0370166	Reporte de progreso de los CKD's. - Ya se cuenta con el Vo.Bo de Fernanda Godínez, el reporte se libera el día 26 de enero.	26/01/2018
		CHG0370059	Funcionalidad Chat en línea	21/02/2018
		INC0180114	Cuestionario del Checklist de los CKD's "Se guarden en la carpeta de Cuestionarios de la unidad U"	16/02/2018



Requerimientos cerrados (16)

No	Requerimiento	No. Ticket	Sub- Requerimiento	Fecha de cierre
2	Reporte de Comparativos	CHG0030234	Calculadora de Black-Litterman "Desarrollo marco conceptual."	16/12/2016
		CHG0030234	Modelo de comparativos " Documento técnico "	16/12/2016
		CHG0030236	Calculadora de Black-Litterman "Optimización por clases de activos sin restricciones"	13/01/2017
		CHG0030234	Calculadora de Black-Litterman "Modelo de optimización con restricciones"	13/01/2017
		CHG0030234	Modelo de comparativos " Planteamiento general del modelo comparativo."	13/01/2017
		CHG0030234	Imputs requeridos para la calculadora de Black- Litterman.	16/02/2017
		CHG0030234	Seguimiento de comparativos	16/02/2017
		CHG0030234	Análisis de SB1.	21/04/2017
		CHG0030234	Expandir modelo actual.	02/05/2017
3	Mejor Ejecución	CHG0030240	Reporte de límites de concentración de las instituciones con las que opera actualmente el Infonavit.	30/01/2017
		CHG0030240	Instalación de la pantalla de Bloomberg anywhere.	23/03/2017
		CHG0370095	Reporte de Seguimiento y comparativos de información del 2016.	19/05/2017
4	Homologación de la Metodología de Riesgos	CHG0370062 Infonavit	Metodología de Riesgos con las que se esta trabajando.	22/03/2017
		CHG0370062 Infonavit	Entrega del Plan de Trabajo del SLA.	07/04/2017
5	Capacitación	No Aplica	Entrega de Material de Capacitación que Ofrece el CFA (Chartered Fired Analyst) 20 Libros en Total 5 cursos diferentes.	24/03/2017
		No Aplica	Capacitación en Asesor en estrategias de Inversión.	24/03/2017



Requerimientos cerrados (14)

No	Requerimiento	No. Ticket	Sub- Requerimiento	Fecha de cierre
6	Crear política y procedimiento de riesgo crediticio CKD's	CHG0030237	Definición del proceso para aprobación de los CKD's	09/12/2016
		CHG0030237	Cuestionario de la debida diligencia.	25/01/2017
7	Reporte de FactSheet de FINVIT1	CHG0370037	Reporte de FactSheet de FINVIT1	24/04/2017
		CHG0370037	Ajustes al Reporte de FactSheet de FINVIT1 para incorporar el numero de afiliados la próxima semana se compartirá la fechas para incorporar la funcionalidad.	24/04/2017
8	Cuentas de Usuario Valmer	No Aplica	Cuentas de Usuario Valmer	18/11/2016
9	Listado de reportes y calculadoras que actualmente están desarrolladas	CHG0030247	Listado de reportes y calculadoras que actualmente están desarrolladas	22/11/2016
10	Simulación de operación de herramientas de riesgos	CHG0030239	Simulación de operación de herramientas de riesgos	25/11/2016
11	Plan de negocio de Pemex	CHG0030244	Plan de negocio de Pemex	02/12/2016
12	Monitor de Finanzas	CHG0030243	Monitor de Finanzas del portal de transparencia	16/12/2016
13	Contacto PAMS en el Infonavit	CHG0030242	Asignación de un Recurso de PAMS en el Infonavit	22/12/2016
14	Planeación y Organización, Gerencia Mercados Financieros.	CHG0030257	Plan de Fortalecimiento Institucional	22/12/2016
15	Herramienta de Inversión PTO	CHG0030245	Herramienta de Inversión PTO	23/12/2016
16	Seguimiento a Emisnet	CHG0030201	Seguimiento a Emisnet	12/01/2017
17	Instrumentos que aportan mayor Riesgo	CHG0030260	Reporte de Instrumentos que aportan mayor Riesgo	13/01/2017



Requerimientos cerrados (15)

No	Requerimiento	No. Ticket	Sub- Requerimiento	Fecha de cierre
18	Videoconferencia en sala de junta de Mercados financieros	CHG0030266	Videoconferencia en sala de junta de Mercados financieros	13/01/2017
19	Histórico del Múltiplo de TIR de todos los CKD's."	CHG0030259	Histórico del Múltiplo de TIR de todos los CKD's."	26/01/2017
20	Dar acceso al área de Riesgos a los sistema de Mercados Financiero.	CHG0370038	Dar acceso al área de Riesgos a los sistema de Mercados Financiero.	20/02/2017
21	Comparación de precios PIP y Valmer en la plataforma tecnológica	CHG0030238	Reporte de Comparación de precios PIP y Valmer en la plataforma tecnológica	10/03/2017
22	Material para el curso de certificación de Siefores	CHG0030265	Material para el curso de certificación de Siefores	10/03/2017
23	Alineación con el área de TI del Infonavit	CHG0370031	Firma del SLA con CG-TI	22/03/2017
24	Origen de Rendimientos	CHG0370041	Reporte de origen de Rendimientos	24/03/2017
25	División de Fondos (Fondo A y Fondo B)	CHG0030263	El reporte de División de Fondos	03/04/2017
26	Integración de Brokers en la plataforma Tecnológica	CHG0370049	Integración de Bróker GFI a Mercados Financieros	14/04/2017
27	Mantenimiento de Mercados Financieros	No aplica	Mantenimiento de Mercados Financieros	22/04/2017
28	Operaciones Semanales del 6 al 10 febrero	CHG0370036	Reporte de Operaciones Semanales del 6 al 10 febrero	24/04/2017
29	Reporte Portafolio semanal	CHG0370139	Se compartió el 27 de abril la ruta de la carpeta con el historial de los reportes de Portafolio semanal.	27/04/2017
30	Generación de Expectativas para estrategias de inversiones	CHG0370125	Generación de Expectativas para estrategias de inversiones	11/05/2017
31	Listado de Requerimientos	CHG0370090	Listado de Requerimientos	12/05/2017
32	PASE para Fibras	CHG0370140	Validación de los dividendos de FIBRAS	12/05/2017



Requerimientos cerrados (9)

No	Requerimiento	No. Ticket	Sub- Requerimiento	Fecha de cierre
33	Generación de Expectativas para estrategias de inversiones.	CHG0370125	Sera una solicitud recurrente mensual de parte del Infonavit, La próxima fecha en que se requiere la información es el 9 de junio.	09/06/2017
34	Análisis del Banco del Bajío	CHG0370156	Requerimiento Atendido.	09/06/2017
35	Pruebas del DRP	CHG0370092	El día domingo 14 de mayo se realizó la prueba de escritorio con el árbol de llamadas. Como resultado de dichas pruebas, el líder de Plan de Continuidad ajusta el árbol de llamadas con base a la documentación entregada por PRO. El día 17 de mayo se realizó la prueba en el sitio alterno, con el Grupo de trabajo, las principales incidencias fueron:	09/06/2017
		CHG0370093	Coordinar capacitación del BCP.- El 16 de junio se realizó la capacitación del área de Mercados Financieros y el día 22 de junio la del área de Tesorería General.	16/06/2017
		CHG0370094	Ya se compartieron los costos de CRIMS AnyWhere para el acceso a la plataforma fuera de la red del Infonavit y del CAT.	7/07/2017
36	Mantenimiento al ticker de Mercados Financieros	INC0170432	El martes 6 de junio se dio mantenimiento correctivo al ticker, ya esta funcionando adecuadamente.	06/06/2017
37	Análisis de la Situación de Abengoa	CHG0370168	El 9 de junio se compartió el resumen del análisis de Abengoa.	9/06/2017
38	S&P IQ Capital	CHG0030264	Ya se cuenta con los usuarios de S&P.	23/06/2017
39	Nota y Presentación para el fortalecimiento del comité de inversiones	CHG0370123	Se entregó la presentación con los ajustes solicitados.	23/06/2017



Requerimientos cerrados (10)

No	Requerimiento	No. Ticket	Sub- Requerimiento	Fecha de cierre
40	Reporte Portafolio semanal	CHG0370065	Reporte FANVIT, FINVIT y Tesorería General, este actividad es recurrente con una frecuencia semanal, en caso de haber comentarios adicionales se registraría como un nuevo requerimiento.	23/06/2017
41	Minutas PAMS	CHG0370127	Se entregó las cartas de evidencia de recepción de las minutas por parte de Mercados Financieros y Nafin.	23/06/2017
42	Portal de Fibras	CHG0370140	Cuestionario de Fibras.- Se liberó el día 7 de junio, adicional se realizó una doble validación de los comentarios de Arturo Hanono.	7/07/2017
43	Planeación y Organización, Gerencia Mercados Financieros.	CHG0030257	Proyecto liderado por Tonatiuh Rodríguez el estatus de este requerimiento se revisa en junta específica del proyecto.	07/07/2017
44	Manual de entendimiento de CKD'S	CHG0370167	El día 15 de junio se compartió el Manual de entendimiento de CKD's.	15/07/2017
45	BCP	CHG0370091	Acceso a la plataforma tecnológica y a CRIMS fuera de la red del Infonavit.- Ya se revisaron los accesos a CRIMS por medio de VPN del Infonavit y no es posible el ingreso por este medio. INC0170577-Infonavit	21/07/2017
46	Integración de los precios en el ticker	CHG0030262	Infosel.- La prueba de concepto de Infosel finalizó el jueves 29 de junio.	29/06/2017
47	Requerimiento Riesgos Institucional	INC0170517	Entrega de los archivos en formato TXT de manera definitiva por parte de COVAF. - Este requerimiento será cancelado y se considerara como solución final el desarrollo que entregó PRO	25/08/2017
		INC0170517	Desarrollo temporal para colocar los archivos de COVAF en TXT. - Se queda como definitiva esta solución.	25/08/2017
48	Análisis de Fibras	INC0170566	Base de datos para analizar, optimizar y seleccionar a las mejores Fibras del mercado, el viernes 25 se liberaron los cambios solicitados por Cesar Villanueva	25/09/2017



Requerimientos cerrados (13)

No	Requerimiento	No. Ticket	Sub- Requerimiento	Fecha de cierre
49	Dar acceso al área de Riesgos a los sistema de Mercados Financiero.	CHG0370038	De acuerdo a la reunión con Francisco Baños se acordó que el área de Mercados Financieros enviara una solicitud formal a PRO para entrega del usuario genérico.	8/09/2017
50	Velocidad de la red inalámbrica para Invitados	INC0170678	El 25 de agosto se realizó el incremento del ancho de banda en la red de Invitados	25/08/2017
51	Conciliación de cartera	CHG0030173	El 7 de septiembre se liberó la funcionalidad en productivo	7/09/2017
52	Portal de Fibras	CHG0370140	Desarrollo de la funcionalidad de FIBRAS en PASE.- La funcionalidad se liberó el 23 de octubre.	23/10/2017
53	Generación de Portafolio de referencia para el Instituto	INC0170596	Se comentó que este requerimiento ya está finalizado y en caso de requerir apoyo por parte de PRO, se generará un nuevo requerimiento.	27/10/2017
54	Temas de Auditoría (Homologación de la Metodología de Riesgos)	INC0170585	Alerta al intentar comprar un instrumento que exceda el límite por emisión o emisor, en espera de validación de parte de Alfredo García.	27/10/2017
		INC0170586	Límite de CKD's: min{10% de la emisión, 600 M}.	27/10/2017
		INC0170587	Límite por contraparte: instrumentos corporativos con garantías.	27/10/2017
		INC0170588	Límite de renta variable global (FANVIT + Tesorería)	7/12/2017
		INC0170589	Límite por contraparte: reporto (global)	7/12/2017
		INC0170565	Homologación de la metodología del VaR histórico generado por Riesgos Institucional: por portafolio y global.- Se finalizó el 7 de Febrero.	16/02/2018
55	Asignación de línea telefónica adicional con Grabación al área de la Tesorería General	INC017069	La asignación de la línea fue atendida el 9 de octubre.	9/10/2017
56	Activación de línea telefónica en Mercados Financieros	INC0170830	La línea, se activo el 13 de octubre.	13/10/2017



Requerimientos cerrados (10)

No	Requerimiento	No. Ticket	Sub- Requerimiento	Fecha de cierre
57	Portal de Fibras	CHG0370140	Desarrollo de la funcionalidad de FIBRAS en PASE.- La funcionalidad se liberó el 23 de octubre.	23/10/2017
58	Préstamo de Valores	CHG0370051	El día 5 de octubre se liberó la funcionalidad en productivo.	5/10/2017
59	Homologar catálogo de Contrapartes	CHG0370015	De acuerdo con la junta de seguimiento con la Tesorería General del día 1 de noviembre, este requerimiento ya está finalizado.	1/10/2017
60	Generación de procesos para la toma de decisiones de clases de activos	INC0170564	Agregar los nombre de los corporativos analizados en la plataforma tecnológica.-La funcionalidad se liberó el 21 de noviembre	21/11/2017
61	Políticas de Riesgo-Crédito.	CHG0370064	El 13 de noviembre compartió Irving González la presentación actualizada al Infonavit.	13/11/2017
62	Alineación con el área de TI del Infonavit.	CHG0370031	El 15 de noviembre la Subdirección de TI, envió un oficio al área de Mercados Financieros, donde se especifica el cierre del hallazgo.	15/11/2017
63	Seguimiento a la Mejor Ejecución.	INC0170523	Etapa 1.- Desarrollo del proceso semi-automático.- Se llevó a cabo reunión con Alfredo García para revisar la funcionalidad y se acordó iniciar con la segunda etapa del proyecto.	13/11/2017
64	Mejor Ejecución Tesorería General	INC0170710	Se acordó en la junta con Tesorería General del día 14 de noviembre que para el requerimiento de la “Mejor Ejecución” no será necesario realizar ningún desarrollo en la Plataforma Tecnológica, debido a que actualmente está información está identificada en un reporte de SIPO.	14/11/2017
65	Respaldo de equipos de cómputo	CHG0370087-Infonavit	El estatus lo estará reportando José Luis R. Grimaldo directamente con Arturo Hanono.	13/11/2017
66	Integración de Brokers en la plataforma Tecnológica “MEI”	CHG0370032	De acuerdo a la reunión con Raúl Alcántara del día 30 de mayo la funcionalidad que propone MEI estará para agosto o septiembre, esta pendiente definir si este requerimiento se llevará a cabo (Cancelado).	13/11/2017



Requerimientos cerrados (10)

No	Requerimiento	No. Ticket	Sub- Requerimiento	Fecha de cierre
67	Análisis de Crédito Corporativo.	INC0180012	Elaborar Proceso de Análisis de Crédito. - El diagrama fue compartido el 18 de diciembre.	18/12/2017
		CHG0370040	<u>Porcentaje general de avance (100%).</u> <u>✓ Total de Corporativos</u> * 38 Corporativos se distribuyen en FANVIT-A (23) y FANVIT-B (15) y 14 Corporativos se analizaron sobre pedido.	52* 26/01/2018
68	Homologación de la Metodología de Riesgos.	INC0170590	Modelos de valuación con curvas cero.	3/01/2018
69	Integración de los precios en el ticker	CHG0370088	Market Data de Reuters. - El contrato esta firmado y ya se cuenta con el usuario de conexión definitivo	12/01/2018
70	Nuevos Fondos	INC0170853	Adecuación de la Interfaz con SAP manual. - El 9 de enero se finalizó el requerimiento con la confirmación de las cuentas contables por parte de Juan José Sánchez .	9/01/2018
71	Etapa 2 Mejor Ejecución	CHG0030240	Incorporación del seguimiento a la mejor ejecución en la Plataforma Tecnológica.- La próxima semana se finaliza la incorporación en la Plataforma Tecnológica, sin embargo hay un proyecto en paralelo liderado por José Luis R. Grimaldo para incorporar el proceso en CRIMS.	26/01/2018
72	Auditoria Interna (13)	No aplica	Se realizó el cierre de las 13 observaciones realizadas por la Auditoría Interna.	26/01/2018
73	Due Diligence	No aplica	El listado de las interfaces que tiene actualmente la Plataforma Tecnológica con CRIMS, se envió el día 22 de enero Arturo Hanono.	22/01/2018
74	Curso AMIB Figura 3	CHG0370169	Las sesiones del curso de repaso, se realizaron el 25 y 26 de enero.	26/01/2018
75	Fibras CFE.	INC0180045	El 1ro. de febrero, se compartió el análisis de la Fibra e.	1/02/2018



Requerimientos cerrados (10)

No	Requerimiento	No. Ticket	Sub- Requerimiento	Fecha de cierre
76	Directorio de Bloomberg	INC0180134	Calendario de los que ya hay Información, ya se agregó la columna para visualizarla.	23/02/2018
77	Mejora en los procesos automáticos del custodio Bancomer	INC0170697	Carga de saldo final/inicial en la Plataforma Tecnológica.- El requerimiento se liberó en el ambiente productivo el 13 de febrero.	13/02/2018
78	Análisis de Acciones individuales	INC0180135	Fase 1.- Las adecuaciones al análisis actual para incorporar la información de manera sectorial, se entregó el 20 de febrero.	20/02/2018
79	Amafore, presentación de los servicios	INC0180047	Cancelado se lleva por medio del requerimientos de ETF's, .- Amafore esta generando el proceso de alta como proveedor en el Infonavit.	23/02/2018
80	Análisis Fonadin	INC0180157	Se entregó el análisis de Fonadin el 27 de febrero.	27/02/2018
81	Junta semanal participación PRO 619	No aplica	La evidencia ya fue entregada a Paula Trumbley.	26/02/2018
82	Manuales del Middle Office 618	No aplica	El manual ya está firmado por Arturo Hanono.	27/02/2018
83	Tecnologías de Información 621:	No aplica	2. - Que se busque una mejor opción de sistema de asignación y recepción de órdenes en lugar de tener a PRO Management System	01/03/2018
		No aplica	3. - Llevar a cabo una bitácora de las actualizaciones correspondientes a los sistemas, así como nuevos desarrollos (Derivados).	01/03/2018
84	Procesos Front Office-Inhibidor de señales 617	No aplica	La evidencia ya fue entregada a Paula Trumbley.	9/03/2018



Requerimientos cerrados (6)

No	Requerimiento	No. Ticket	Sub- Requerimiento	Fecha de cierre
85	Valuación Periódica y análisis Prudencial 620	No aplica	<p>1.- Realizar una valuación periódica de una muestra representativa de los activos objetos de inversión con base en los precios del vector de Precios; así como una verificación periódica acerca de los precios del vector.</p> <p>2. - Que el área de Análisis Prudencial realice la verificación del Security Master, así como la parametrización al cierre del mes y una vez cada trimestre</p> <p>3. - Que el área de Análisis Prudencial tenga los perfiles y facultades, así como el encargado y responsable de revisar a detalle el Security Master (Dependiente del punto anterior.</p> <p>5.- Que la Contraloría Normativa de Inversiones tenga los chats respaldados diariamente, dado que es la evidencia documental de cómo se generó la operación</p> <p>6. - Se tenga un “Service Level Agreement” con Reuters, esto con el objetivo de poder consultar y tener evidencia documental de los chats.</p> <p>9. - Que se realice un análisis técnico para algunos activos objetos de inversión</p>	28/02/2018 28/02/2018 28/02/2018 28/02/2018 28/02/2018 28/02/2018



Relación de Firmas

Recibe:

ARTURO HANONO CASTAÑEDA
GERENTE SR.
GERENCIA SR. COORDINACION INVERSIONES

JUAN ENRIQUE TRUEBA CALLEJA
GERENTE SR 15
GERENCIA SR. COORDINACION INVERSIONES

PAULA SUSANA TRUMBLEY
CONSULTORA JR. 10
GERENCIA SR. COORDINACION INVERSIONES

Entrega:

LUIS ENRIQUE PARRA ALMAGUER
PROFESSIONAL ASSET MANAGEMENT
SYSTEMS,S.A. DE C.V

JORGE RENÉ ARROYO
PROFESSIONAL ASSET MANAGEMENT
SYSTEMS,S.A. DE C.

IRVING GONZÁLEZ HERNÁNDEZ
PROFESSIONAL ASSET MANAGEMENT
SYSTEMS,S.A. DE C.V

EDUARDO ELIZONDO SHIELDS
PROFESSIONAL ASSET MANAGEMENT
SYSTEMS,S.A. DE C.V