



UNIDAD DE ADMINISTRACIÓN INTEGRAL DE RIESGOS (UAIR) (Conformación y Administración)



DICIEMBRE 2023



RiskMathics
FINANCIAL INSTITUTE

UNIDAD DE ADMINISTRACIÓN INTEGRAL DE RIESGOS (UAIR) (CONFORMACIÓN Y ADMINISTRACIÓN)



ANDRÉS CORONA

Professional Risk Manager

Andrés Corona es pionero en la implementación de Metodologías y Modelos de Administración Integral de Riesgos, tanto en México como en varios países de LATAM. Durante 23 años trabajó, entre otros, como Director de Administración Integral de Riesgos y Control Interno de Riesgos en BBVA Bancomer y Grupo BBVA, en donde logró la certificación de algunos de estos modelos internos como Modelos IRB, cumpliendo con el estándar de Basilea III, para creación de Reservas de Crédito y la asignación de Capital, ante la CNBV y Banco de España.

TEMARIO:

1. ¿Cuáles son las Funciones y Estructura óptima de la UAIR?
2. ¿Cómo integrar y analizar el Perfil de Riesgos de la Institución-Mapa de Capital?
3. ¿Hasta dónde debe llegar Marco para la Administración Integral de Riesgos?
4. ¿Cómo definir el “Apetito de Riesgo” y los Límites de Exposición al Riesgo?
5. ¿Cómo seleccionar los Niveles de Tolerancia al Riesgo por UN y Factor de Riesgo?
6. ¿Qué incluir y cómo medir los Riesgos No Discrecionales (R. Operativo, R. Tecnológico y R. Legal)?
7. ¿Cómo gestionar los Riesgos No Cuantificables (R. Estratégico, R. de Negocio y R. Reputacional)?
8. ¿Cómo optimizar APR’s y los Requerimientos Regulatorios de Capital?
9. ¿Cómo integrar las Proyecciones de Capital y realizar Análisis de Sensibilidad y Escenarios de Estrés?
10. ¿Qué hay que analizar en el informe de Evaluación de Suficiencia de Capital?
11. ¿Cómo analizar los Indicadores de Riesgo de Liquidez?
12. ¿Cuál es el alcance de los Planes de Contingencia y de Financiamiento de Contingencia?
13. ¿Cómo hacer la valuación, medición y control de riesgo de nuevos productos y servicios?
14. ¿Qué elementos clave en materia de capital humano se deben de considerar para conformar la UAIR?
15. BEm y su entorno de crecimiento y competencia
16. Gobierno de la función de riesgos en México
17. Principios directores del apetito de riesgo y la gestión de valor
18. Cálculo de requerimientos de capital
19. Rentabilidad y alineación de incentivos
20. Conclusiones

DICIEMBRE 2023

D	L	M	M	J	V	S
					1	2
3	4	5	6	7	8	9
10	11	12	13	14	15	16
17	18	19	20	21	22	23
24	25	26	27	28	29	30
31						