



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



**AGOSTO 2019  
CIUDAD DE MÉXICO**



**RiskMathics**  
FINANCIAL INSTITUTE

## OBJETIVO

Dotar de herramientas de análisis y decisión a los diversos elementos que intervienen en la Unidad de Administración Integral de Riesgos en las instituciones financieras, a través de casos y ejercicios prácticos en donde se revisen los conceptos y la regulación con ejemplos que permitan, utilizando los datos de sus propias empresas, identificar el tipo de decisiones de riesgo y de negocio que se soportan en tales herramientas y el impacto en los resultados financieros y no financieros de la empresa.

Asimismo, ver los procesos, procedimientos y elementos que se requieren para formar, administrar y llevar de forma eficiente la UAIR en una institución financiera.

## DIRIGIDO A

Miembros del Comité de Riesgos, Responsables de la UAIR, Especialistas de Gestión de Riesgos, Auditores de la función de Riesgos y Responsables de Control interno de Riesgos, entre otros.

## PROFESOR

### 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.

# CALENDARIO 2019

## AGOSTO

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

## SEPTIEMBRE

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					

HORARIO:

Lunes - Jueves

7:00 PM - 10:00 PM

# 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

## REQUISITOS

Para lograr un óptimo aprovechamiento a lo largo de este curso, se recomienda a los participantes ser egresados de áreas de carreras económico - administrativas, contar con una formación Matemática de nivel medio y/o superior, y/o tener experiencia profesional dentro de instituciones del medio financiero.

Es fundamental que el participante cuente con Computadora Personal (LapTop).

## COSTO

\$25,000 M.N. + IVA

## SEDE

### UNIVERSIDAD ANÁHUAC MÉXICO NORTE

Av. Lomas Anáhuac s/n Col. Lomas Anáhuac, Huixquilucan  
Edo. de México C.P. 52786



RiskMathics  
FINANCIAL INSTITUTE

## REGISTRO E INSCRIPCIONES

### TELÉFONOS (MÉXICO):

+52 (55) 5536 4325

+52 (55) 5669 4729

E-MAIL: [derivatives@riskmathics.com](mailto:derivatives@riskmathics.com)

## OPCIONES DE PAGO

Residentes e instituciones establecidas en México

Transferencia y/o Depósito Bancario

NOMBRE: RiskMathics, S.C.

BANCO: BBVA Bancomer

CLABE: 012180001105829640

CUENTA: 0110582964

Residentes e instituciones establecidas en el extranjero

Transferencia Bancaria en Dólares

BANCO: BBVA Bancomer

SUCURSAL: 0956

SWIFT: BCMRMXMM

BENEFICIARIO: RiskMathics, S.C.

CUENTA: 0121 8000 11 0583 0066

Pago vía telefónica

Tarjeta de crédito VISA, MASTERCARD o AMERICAN EXPRESS

Pago en línea

[www.riskmathics.com](http://www.riskmathics.com)

**NOTA IMPORTANTE:**  
**NO HAY**  
**REEMBOLSOS, NI**  
**DEVOLUCIONES.**

SÍGUENOS EN  
RiskMathicsFI

