

TABLA DE CONTENIDO

1. INTRODUCCIÓN	5
2. OBJETIVOS	6
2.1. Objetivo General.....	6
2.2. Objetivos Especificos	7
3. METODOLOGIA	7
4. DIAGNOSTICO	8
4.1. Diagnóstico Interno. Alto Nivel.....	8
4.2. Diagnóstico Interno. Según Basilea II.....	15
4.2.1. Modelo de Gobierno Corporativo.....	15
4.2.2. Estructura Organizativa de Riesgo Operacional	16
4.2.3. Modelo de Gestión de Riesgo Operacional.....	21
4.2.3.1. Visión General	21
4.2.3.2. Modelo Gráfico	22
4.2.3.3. Identificación de Riesgos.....	23
4.2.3.4. Identificación de Controles	26
4.2.3.5. Evaluación de Riesgos y Controles	28
5. CONCLUSIONES	56
5.1. Recomendaciones.....	57
6. BIBLIOGRAFÍA	59
ANEXO Y APENDICES.....	60

ÍNDICE DE TABLAS

TABLA 1: CALIFICACIONES DE LA RAN 1-13, SBIF. 1	10
TABLA 2: CALIFICACIONES DISTRIBUCIÓN, ELABORACIÓN PROPIA.	11
TABLA 3: TABLA RESULTADOS PROMEDIOS DE CALIFICACIONES, ELABORACIÓN PROPIA.	12
TABLA 4: PEORES PREGUNTAS SEGÚN CALIFICACIONES, ELABORACIÓN PROPIA.	14
TABLA 5: RESUMEN DE LÍNEAS DE NEGOCIO.....	26
TABLA 6: ESCALA DE VALORIZACIÓN CONTROLES – COBERTURA, ELABORACIÓN PROPIA.	34
TABLA 7: ESCALA DE VALORIZACIÓN CONTROLES – EFECTIVIDAD, ELABORACIÓN PROPIA.	35
TABLA 8: VALORIZACIÓN DE IMPACTO EN CLIENTES, ELABORACIÓN PROPIA.....	38
TABLA 9: VALORIZACIÓN DE IMPACTO REPUTACIONAL, ELABORACIÓN PROPIA.	39

ÍNDICE DE ILUSTRACIONES Y GRÁFICOS

ILUSTRACIÓN 1: GOBIERNO CORPORATIVO, ELABORACIÓN PROPIA.....	16
ILUSTRACIÓN 2: ORGANIGRAMA, ELABORACIÓN PROPIA	17
ILUSTRACIÓN 3: MODELO DE GESTIÓN, ELABORACIÓN PROPIA	22
ILUSTRACIÓN 5: FASES DE CONSTRUCCIÓN ICR B2.2., ELABORACIÓN PROPIA.	50
ILUSTRACIÓN 6: FASES DE CONSTRUCCIÓN ICR B2.3., ELABORACIÓN PROPIA.	51
ILUSTRACIÓN 7: DEFINICIONES DE CATEGORÍAS DE LA MATRIZ DE AUTOEVALUACIÓN DE GESTIÓN Y SOLVENCIA. SBIF RAN 1-13, ANEXO N°1.	60