

Índice

Resumen Ejecutivo	5
Introducción	7
Entidades Participantes	8
Metodología del Estudio	9
Enfoque Regulatorio	10
Modelo de Gestión	12
Marco de gestión	15
Identificación de eventos de pérdida	24
Identificación de riesgos y mitigantes	30
Autoevaluación	35
Cálculo de capital	40
Gestión y seguimiento	46
Entorno tecnológico	53
Análisis de posicionamiento	57
Conclusiones	61
Colaboraciones	
Entrevista a Jordi García (BBVA)	62
Entrevista a Virginia González (Santander)	64
Artículo de Santiago Carrillo	66
Anexos:	
La experiencia de Basilea II en los grandes bancos	69
Los componentes de la gestión del riesgo operacional: lecciones aprendidas en la banca internacional	70
Alineando la gestión de riesgo operacional con la de resultados	76
Modelo de referencia para el análisis de posicionamiento	79
Glosario de términos	87