

Matriz de riesgo de un grupo o conglomerado financiero (GCF)

| Grupo o conglomerado financiero: | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------------------------|------------------------------------|------------------|---------|-------------|-------------|---------|------------------------|---------------------|---------------|----------------------|-------------------|---------------------|----------------------------------|-------------------|-------------|-----------|-------------|
| Fecha: | | Riesgo inherente | | | | | Gestión de riesgos | | | | | | | | Riesgo neto | Dirección | Importancia |
| Actividades significativas (Nivel 3) | | Crédito | Mercado | Operacional | Estratégico | Seguros | Gestión de operaciones | Órgano de dirección | Alta gerencia | Dirección de riesgos | Auditoría Interna | Análisis financiero | Cumplimiento legal y regulatorio | Función actuarial | | | |
| | | 1 | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 4 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | Calificación de gestión de riesgos | | | | | | | | | | | | | | | | |

| | Calificación | Dirección |
|-------------------------|--------------|-----------|
| Riesgo neto total | | |
| Riesgo estratégico | | |
| Riesgo de contagio | | |
| Riesgo de concentración | | |
| Riesgo LC/FT | | |
| Riesgo neto compuesto | | |
| Capital | | |
| Utilidades | | |
| Liquidez | | |

| | |
|---------------------------|--|
| Perfil de riesgo | |
| Importancia sistémica | |
| Estrategia de supervisión | |