

7.1.3.3.1 División de Riesgos de Inversión

1. Actualizar la metodología, parámetros y sistemas para la determinación del Valor en Riesgo de la posición institucional y la administrada por terceros de los portafolios de inversión, y elaborar los reportes e indicadores correspondientes.
2. Diseñar y proponer el establecimiento de límites de inversión de los recursos institucionales y administrados por terceros, por reserva, clase de activo, contraparte financiera autorizada, tipo de operación, factor de riesgo, entre otros.
3. Diseñar y elaborar informes en materia de riesgos de mercado y crédito, de los recursos institucionales y administrados por terceros para su integración a los que deba rendir la Dirección de Finanzas.
4. Realizar análisis e informes sobre las mejores prácticas internacionales en materia de administración de riesgos de mercado y crédito.
5. Elaborar y mantener actualizado el marco normativo para el monitoreo y administración de riesgos de mercado y crédito, a que están expuestas las inversiones del Instituto.
6. Verificar el debido cumplimiento de los acuerdos de los órganos colegiados, relacionados con los asuntos de su competencia.
7. Diseñar y elaborar propuestas de políticas y directrices para la administración de los riesgos de mercado y crédito, para su inclusión en la normatividad correspondiente.
8. Definir los modelos matemáticos financieros para la valuación a mercado de instrumentos, así como la estimación de los riesgos de mercado y crédito de los portafolios de inversión.
9. Aplicar las metodologías aprobadas para la identificación, valuación, medición, administración y seguimiento del riesgo de mercado y crédito de los recursos institucionales y administrados por terceros.
10. Supervisar y mantener actualizado el sistema de administración de riesgos con modelos que permitan evaluar los riesgos de mercado y crédito de los recursos financieros institucionales y administrados por terceros.
11. Realizar, conforme a la normatividad vigente, el análisis de las diferentes contrapartes, emisores e intermediarios financieros para las operaciones de inversión de los recursos financieros institucionales.

12. Analizar los riesgos de inversión de los recursos institucionales y administrados por terceros, inherentes a los cambios en los factores de riesgo y verificar que se cumplan los límites establecidos e informar de sus resultados.
13. Elaborar y proporcionar la documentación de los asuntos de su competencia que se deban integrar al informe de inversiones financieras de los recursos institucionales y administrados por terceros, que analizará la Comisión de Inversiones Financieras.
14. Realizar las actividades relacionadas con la gestión del riesgo operativo de sus procesos y elaborar los informes requeridos y relacionados con este tipo de riesgo.
15. Realizar el análisis fundamental de emisores de deuda para evaluar y dar seguimiento a la exposición dentro de las Reservas Operativas y Financieras y Actuariales, así como del Fondo para el Cumplimiento de las Obligaciones Laborales de Carácter Legal o Contractual del Instituto.
16. Dar seguimiento al riesgo de contraparte en las operaciones de fondeo.
17. Elaborar un análisis previo a la inversión en emisiones bursatilizadas y darle seguimiento.
18. Elaborar, al menos semestralmente, el listado de contrapartes e intermediarios vigentes.
19. Informar las acciones de calificación crediticia, por parte de las instituciones calificadoras, por evento, para las contrapartes y emisores autorizados.
20. Elaborar trimestralmente un informe de las posiciones clasificadas como de alto riesgo de inversión.
21. Integrar la posición de las inversiones tercerizadas, validarlas, valuarlas y medir sus respectivos indicadores de riesgo y desempeño, así como dar seguimiento al régimen de inversión y sus correspondientes límites establecidos.
22. Llevar a cabo los procesos de contratación de los servicios de proveeduría de precios y del sistema de administración de riesgos financieros con proveedores externos.
23. Proporcionar atención a las solicitudes de información que realicen los diferentes órganos fiscalizadores en relación con los asuntos que competen a la División de Riesgos de Inversión, para promover la transparencia y el acceso a la información pública.



MANUAL DE ORGANIZACIÓN DE LA DIRECCIÓN DE FINANZAS

24. Las demás que le encomiende la persona titular de la Coordinación de Administración de Riesgos Financieros y/o la persona titular de la Unidad de Riesgos Financieros y Actuariales.