



INSTITUTO DE FINANZAS
DE SANTO DOMINGO

CURSO GESTIÓN INTEGRAL DE RIESGOS

AGOSTO 2021

OBJETIVOS DEL PROGRAMA

- Entender el proceso de gestión Integral del riesgo para instituciones financieras identificando, describiendo y diferenciado cada tipo de riesgos.
- Explicar cómo puede surgir cada tipo de riesgo y evaluar el impacto potencial en una institución financiera.
- Definir las mejores prácticas en el proceso de gestión de riesgo de mercado, crédito, liquidez y operativo.
- Entender las principales herramientas y procedimientos utilizados para medir y gestionar el riesgo, tanto cuantitativo como cualitativo.
- Entender las estrategias de mitigación empleada por instituciones financieras así como los productos derivados que permiten realizar una gestión de estos riesgos. Comprender las ventajas y desventajas de cada una de estas estrategias.

METODOLOGÍA

La duración de la capacitación será de 12 horas, divididas en sesiones de 2 horas cada una, con ejercicios prácticos y aplicación de herramientas.

CONTENIDO DEL PROGRAMA

Sesión 1: Introducción a la Gestión Integral de Riesgos

- Fundamentos de la Supervisión Basada en Riesgos (RBA/SBR), la Regulación Financiera Internacional y la Gestión Integral de Riesgos.
- Tipología de los Riesgos y Lecciones de Casos de Pérdidas. Repaso Estadístico y Aproximación de Escenarios de Tensión.
- Definición y aplicaciones de Mediciones de Riesgos de Mercado (DEAR, VAR, C-VAR: histórico, varianzas y covarianzas, y Montecarlo) y Escenarios de Tensión.

Sesión 2: Riesgo de Mercado y Contraparte

- Instrumentos de Renta Fija y Medición de sus Riesgos de Mercado. (DEAR y VAR).
- Fundamentos del Riesgo de Crédito y Contraparte. Mejores prácticas. Experiencia bajo periodo COVID.
- Evaluación Financiera de la Capacidad de Pago del Deudor: Aplicación de Casos. Simulaciones para Periodo Post COVID.

CONTENIDO DEL PROGRAMA (CONT.)



Sesión 3: Instrumentos derivados como estrategia para gestión

- El Riesgo Cambiario: la Determinación de la Posición de Cambios, los Límites Cambiarios, y los Modelos de Cargas de Capital.
- Instrumentos Derivados e Introducción a la Gestión del Riesgo Cambiario a través del Uso de Derivados Financieros. Ejercicios.
- Valoración de los Instrumentos Financieros Derivados.
- Forwards: conceptos, características, mercados. Valorización y Ejercicios.
- Opciones: conceptos, tipología, características, y estrategias.

Sesión 4: Gestión del Riesgo de Liquidez y Tasa de Interés

- Los Principios Básicos para la Gestión del Riesgo de Liquidez y Tasa de Interés
- Los Swaps de Tasas de Interés y de Monedas: conceptos, características, y ejercicios.
- Regulación Financiera de la Gestión del Riesgo de Liquidez. Ratio de Cobertura de Liquidez y Ratio de Financiamiento Estable Neto.
- Las Buenas Prácticas y la Regulación de las carteras de instrumentos derivados financieros.

CONTENIDO DEL PROGRAMA (CONT.)

Sesión 5: Riesgo Operativo y Ciberseguridad

- La Gestión del Riesgo Operacional. La Gestión del Riesgo de Ciberataques: la Seguridad de la Información (GSI) y la Gestión de la Continuidad de Negocios (GCN).
- Aplicación de Evaluación de Riesgo Operacional.
- Aplicación de Ejercicio de Auto Suficiencia de Capital.

PERFIL DEL DOCENTE

JOSÉ JUAN TEJADA

Economista con postgrado en Gestión Financiera por la Pontificia Universidad Católica Madre y Maestra (PUCMM) y Máster en Administración de Negocios (MBA) por Barna Management School. Formó parte del equipo ganador a nivel mundial de la prestigiosa competencia de finanzas del CFA Institute. Posee más de diez años de experiencia en la banca dominicana y puesto de bolsa. Actualmente se desempeña como Gerente de Riesgos en Primma Valores Puesto de Bolsa y cuenta con experiencia docente en diversas instituciones.

INFORMACIÓN GENERAL

Duración:	12 horas
Horario:	Martes y jueves de 6:30 a 8:30 p.m.
Fecha de inicio:	24 de Agosto, 2021.
Modalidad:	Virtual (Zoom)
Inversión:	US\$325.00*
	*Descuentos por grupos de 3 o más de una misma institución.
Incluye:	Material de apoyo y certificado, en formato digital.

OTRAS INFORMACIONES

- Es fundamental que el participante cuente con una computadora equipada con MS Office.
- Los ejercicios y modelos utilizados y desarrollados en el transcurso del programa serán compartidos con los participantes del curso.



INSTITUTO DE FINANZAS
DE SANTO DOMINGO

CONTACTO:

INFO@IFISD.COM

TELÉFONO/WAPP 829.946.0983