

CURSO-TALLER VALUE AT RISK (VaR)

DIRIGIDO A:

Profesionales de las áreas de tesorería y riesgos de fondos de pensiones, aseguradoras, puestos de bolsa, bancos, asociaciones de ahorros y préstamos, fondos de inversión, fiduciarias, reguladores, proveedoras de precios y participantes del sector financiero en general.

OBJETIVOS:

Dotar a los participantes de los conocimientos teórico-prácticos en la metodología más importante de medición de riesgo de mercado. Los participantes aprenderán la trascendencia del VaR (Value at Risk), sus características, ventajas y desventajas. Así mismo, se desarrollarán las habilidades necesarias para implementar esta metodología en portafolios conformados por instrumentos locales e internacionales.

CONTENIDO:

TEMA I: Caracterización del Riesgo de Mercado

- Momentos de la distribución
- Tipos de distribución
- Caracterización de una distribución
- Matriz Varianza-Covarianza

TEMA II: Value at Risk

- La metodología del VaR
- VaR Paramétrico
- VaR Histórico
- VaR Condicional
- VaR Montecarlo
- Stressed VaR
- Backtesting del VaR

TEMA III: Aplicaciones de Value at Risk

- Portafolios de renta fija
- VaR para instituciones de intermediación financiera con ALM
- VaR de Liquidez
- Stress Testing

EXPOSITOR:

Victor J. Reyes, CFA, CAIA

Licenciado en Economía con Post-grado en Finanzas Corporativas del INTEC. Cuenta con una maestría en Economía Aplicada (UCSD-Empírica) y maestría en Finanzas con especialización en sistemas financieros y mercados de capitales por la Universidad Torcuato Di Tella. Posee las certificaciones Chartered Financial Analyst (CFA) y Chartered Alternative Investment Analyst (CAIA). Cuenta con más de 15 años de experiencia en posiciones de análisis económico y financiero. Se ha desempeñado como tesorero, asesor y consultor de varias instituciones del sector financiero dominicano y docente a nivel de maestría por más de 12 años. Es pionero en el desarrollo de modelos de tasas de interés y medición de riesgos de tasas interés en la República Dominicana.

DATOS GENERALES

Fecha: Lunes y miércoles, del 2 al 18 de mayo

Horario: Días 2, 4 y 11 de 6:30 a 8:30pm,
día 9 de 6:00 a 9:00pm (presencial),
días 16 y 18 de 6:30 a 8:00pm.

Duración: 12 hrs.

Inversión: US\$495.00

Modalidad: 5 sesiones virtuales y 1 sesión presencial

Requisitos: Disponer de computadora equipada con MS Excel y acceso a plataforma Zoom. Se recomienda que los participantes cuenten con una formación matemática de nivel medio/superior y tener experiencia profesional dentro de instituciones del sector financiero

CONTACTO PARA INSCRIPCIONES:

INFO@IFISD.COM
Tel./WApp 829.946.0983

