



INSTITUTO DE FINANZAS  
DE SANTO DOMINGO

# **CURSO-TALLER ADMINISTRACION DE RIESGOS FINANCIEROS**

Septiembre-Octubre  
2022

## **CURSO-TALLER**

# **ADMINISTRACION DE RIESGOS FINANCIEROS**

### **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 teóricos-prácticos en la identificación, medición y cuantificación de los riesgos financieros, considerando las mejores prácticas y las particularidades del mercado local.

# CONTENIDO DEL PROGRAMA

## Tema I: Conceptos de Estadística Matemática y Probabilidad.

## Tema II: Riesgo de Crédito (Individual y de Portafolio).

- Modelo de Merton
- Matriz de migración
- Z-Score de Altman
- PD, LGD, EAD
- EL y UL crédito individual
- EL y UL cartera de crédito Exposición Esperada (EE)
- Exposición futura potencial (PFE)
- Exposición Positiva Esperada (EPE)
- Exposición Máxima futura potencial (Max PFE)
- Exposición Esperada Efectiva (EEE)
- Exposición Positiva Esperada Efectiva (EEPE)
- CVA y CVA spread
- DVA y CVA Bilateral
- VaR de una cartera de crédito

## CONTENIDO DEL PROGRAMA (CONT.)

### **Tema III: Riesgo de Mercado, Stress & Back Testing.**

- Fuentes del Riesgo de Mercado en una institución financiera.
- VaR y CVaR.
- Prueba de Kupiec.

### **Tema IV: Riesgo de Liquidez.**

- Gestión del riesgo de liquidez
- Ratio de cobertura de liquidez
- Modelos de brecha de liquidez
- Modelos de recuperación de liquidez
- Riesgo de liquidez y su impacto en el balance

## PERFIL DE LOS FACILITADORES

### **Rosa Bidó, MSc.**

Licenciada en Economía egresada de la Universidad Autónoma de Santo Domingo (UASD). Máster en Economía Financiera Cuantitativa por Oklahoma State University, Máster en Banca y Asesoría Financiera por el Centro de Estudios Financieros (España), Diploma en Inversiones y Trading de la Chicago Board Options Exchange. Se ha desempeñado como Consultora en Economía y Mercado de Capitales, ha ocupado la posición de Gerente de Riesgos Financieros y actualmente es Gerente de Análisis de Inversiones para AFP Crecer. Ha realizado diversos trabajos de investigación y posee más de 5 años de experiencia docente.

### **Gilbert Méndez, CFA, FRM**

Licenciado en Economía con Máster en Gestión de Riesgos y Tesorería, ambos títulos otorgados por la Pontificia Universidad Católica Madre y Maestra (PUCMM). Certificado como Chartered Financial Analyst (CFA) por el CFA Institute y como Financial Risk Manager (FRM) por la Organización GARP. Cuenta con más de 10 años de experiencia en la banca dominicana enfocado en las áreas de Tesorería y Riesgos. Actualmente se desempeña como Gerente Monitoreo Riesgo de Mercado y Liquidez en el Banco Popular Dominicano. Posee experiencia docente en diversas instituciones y universidades orientado a las áreas de Riesgo y Tesorería.

## PERFIL DE LOS FACILITADORES (CONT.)

### **José Juan Tejada, MBA**

Economista con Postgrado en Gestión Financiera por la Pontificia Universidad Católica Madre y Maestra (PUCMM). En adición, cuenta con un Máster en Administración de Negocios (MBA) de la escuela Barna Management School, formó parte del equipo ganador a nivel mundial de la prestigiosa competencia de finanzas del instituto de Chartered Financial Analysts (CFA). Posee experiencia en la banca dominicana y puesto de bolsa. Actualmente se desempeña como Gerente de Riesgos en Primma Valores, Puesto de Bolsa, S.A, y a la vez como docente en el área Financiera.

### **Luis Baranda, CFA**

Licenciado en Economía de la Universidad de Buenos Aires (UBA), cuenta con una maestría en Finanzas de la Universidad Torcuato Di Tella y es CFA Charterholder. Cuenta con 15 años de experiencia en el sector financiero en áreas de Riesgo y Tesorería para Latinoamérica. Actualmente es ALM Treasury Trader en Banco Itaú Paraguay. Posee 7 años de experiencia docente en diversas instituciones con enfoque en las áreas de Economía y Finanzas.

## INFORMACIÓN GENERAL

<b>Fecha:</b>	Martes y jueves, del 6 de septiembre al 11 de octubre.
<b>Horario:</b>	De 6:30 p.m. a 8:30 p.m.
<b>Duración:</b>	22 hrs.
<b>Modalidad:</b>	Virtual 100%
<b>Inversión:</b>	US\$495.00*

\*10% de descuento por 3 participantes o más de una misma institución.

## OTRAS INFORMACIONES

- Cada participante debe disponer de computadora equipada con MS Excel y acceso a plataforma Zoom.
- Es recomendable que los participantes cuenten con una formación matemática de nivel medio/superior y tener experiencia profesional dentro de instituciones del sector financiero.
- Se requiere asistir al 80% de las clases para recibir el certificado de participación.



Para inscripciones completar el formulario de inscripción mediante enlace debajo y enviar a:  
[info@ifisd.com](mailto:info@ifisd.com)

[LINK FORMULARIO DE INSCRIPCIÓN](#)

DATOS BANCARIOS:

**Scotiabank**

Cuenta Corriente en DOP (tasa del día de pago)

#45100242901

Cuenta de Ahorros en USD

#45102409514

Enviar comprobante de pago a: [info@ifisd.com](mailto:info@ifisd.com)

TELÉFONO/WAPP 829.946.0983

