



INSTITUTO DE FINANZAS
DE SANTO DOMINGO

Quantitative Risk Management Workshop

Octubre-Noviembre
2022

Quantitative Risk Management Workshop



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 e interesados en elevar su formación en el área de riesgo financiero.

Objetivos Generales:

Conocer las técnicas aplicadas de métodos cuantitativos en materia de riesgo de mercado según el enfoque de la GARP y el programa FRM. Desarrollar habilidades para construir modelos de riesgos y realizar una evaluación probabilística utilizando el lenguaje R.

Contenido del programa:

- Introducción al QRM y el marco de gobernanza de gestión de riesgos .
- Repaso de probabilidades y tópicos de RM.
- Modelos de volatilidad.
- Introducción y fundamentos en R.
- QRM aplicado en R: Volatilidad y metodologías de Value-at-Risk (VaR).
- QRM aplicado en R: Simulación de Montecarlo.
- QRM aplicado en R: Backtesting de modelos.
- Tópicos especiales en RM.

Quantitative Risk Management Workshop



Perfil del facilitador:

Stefan Bolta, FRM, ERP

Licenciado en Economía con Maestría en Gestión de Riesgos y Tesorería por la Pontificia Universidad Católica Madre y Maestra (PUCMM). Cuenta con un postgrado en Data Science por la Universidad John Hopkins (EEUU). Certificado como Financial Risk Manager (FRM) y como Energy Risk Professional (ERP) por la Organización GARP. Cuenta con más de 12 años de experiencia en el área de Riesgo, actualmente ocupa la posición de Director de Investigaciones en la Superintendencia de Bancos de la Rep. Dom. Posee vasta experiencia como expositor y docente en diversas instituciones y universidades orientado a las áreas de Riesgo y Tesorería.

Quantitative Risk Management Workshop



Informaciones generales:

Fecha:	Del 08 de octubre al 19 de noviembre - No docencia el sábado 22 de octubre -
Horario:	Sábados, de 9:00am a 12:00pm
Duración:	18 hrs.
Modalidad:	Híbrida (Sesiones presenciales y virtuales)
Inversión:	US\$545.00*

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

Otras informaciones:

- Es importante que el participante tenga formación o experiencia en riesgo de mercado.
- No se requiere experiencia en programación, pero sí un nivel intermedio en Excel.
- Cada participante debe disponer de una laptop equipada con MS Excel y acceso a la plataforma Zoom.
- Se requiere asistir al 80% de las clases para recibir el certificado de participación.



Para inscripciones, favor completar el formulario de inscripción mediante el enlace debajo y enviar a:
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

TELÉFONO/WAPP 829.946.0983

