



INSTITUTO DE FINANZAS  
DE SANTO DOMINGO

# **CURSO-TALLER**

# **GESTIÓN INTEGRAL DE RIESGOS**

Febrero 2023

## **DIRIGIDO A**

Profesionales de las áreas de tesorería y riesgos del sector bancario, aseguradoras, puestos de bolsa, fondos de pensiones, fondos de inversión, fiduciarias, reguladores y participantes del sector financiero en general.

## **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.

## **METODOLOGÍA**

Esta capacitación se imparte con un enfoque teórico-práctico, considerando el marco regulatorio de la Rep. Dom.

La duración del programa es de 14 horas, dividido en sesiones de 3 horas, con ejercicios prácticos y aplicación de herramientas.

## CONTENIDO DEL PROGRAMA

### **Tema 1: Introducción a la Gestión Integral de Riesgos (2 hrs)**

- 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.

### **Tema 2: Riesgo de Mercado y Contraparte (3 hrs)**

- Instrumentos de Renta Fija y Medición de sus Riesgos de Mercado (DEAR y VAR).
- El Riesgo Cambiario: la Determinación de la Posición de Cambios y los Límites Cambiarios.
- Fundamentos del Riesgo de Crédito y Contraparte. Mejores prácticas.
- Evaluación Financiera de la Capacidad de Pago del Deudor: Aplicación de Casos.

## CONTENIDO DEL PROGRAMA (CONT.)

### Tema 3: Riesgo de Crédito (3 hrs)

- Default y probabilidad de default.
- Exposición al incumplimiento (EAD).
- Severidad en el incumplimiento (LGD).
- Métricas del riesgo de crédito.
- Capital regulatorio por riesgo de crédito.

### Tema 4: Gestión del Riesgo de Liquidez y Tasa de Interés (3 hrs)

- 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.)

### **Tema 5: Riesgo Operativo y Ciberseguridad (3 hrs)**

- 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 DE LOS FACILITADORES

### **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 10 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 4 años de experiencia docente en diversas instituciones.

### **JUAN QUIÑONEZ**

Economista con maestría en Economía Aplicada de Utah State University y estudios de postgrado en Estadística Aplicada a Negocios. Cuenta con más de 8 años de experiencia en el sector bancario e investigación macroeconómica. Ha desempeñado funciones gerenciales en el área de riesgo de crédito, mercado y liquidez, al igual que como investigador en temas de economía, aprendizaje computacional y ciencia de datos. Actualmente labora como Consultor Económico de Yunque Capital y posee más de 3 años de experiencia docente.

## PERFIL DE LOS FACILITADORES (cont.)

### **CIBELES JIMÉNEZ**

Economista egresada de PUCMM, cuenta con las certificaciones ISO31000 Senior Lead Risk Manager, Certificación Internacional Gestión Integral de Riesgo de Némesis y es egresada del Programa Desarrollo Directivo de Barna Management School. Posee más de 15 años de experiencia en el sector financiero, especializándose en gestión integral de riesgos y gobierno corporativo, logrando implementar sistemas de GIR en nuevas entidades del sector. Actualmente es Directora Ejecutiva del Club de Gestión de Riesgos de República Dominicana y es socia fundadora de Ribels SRL, cuenta con más de 4 años de experiencia docente.

## INFORMACIÓN GENERAL

- Duración:** 14 horas
- Horario:** Martes y jueves de 6:00 a 9:00 p.m.
- Fecha:** Del 23 de febrero al 09 de marzo, 2023.
- Modalidad:** 4 días presenciales, 1 día virtual (1ero.)
- Inversión:** US\$440.00\*
- \*10% descuento al inscribir tres o más participantes de una institución.
- Incluye:** Material de apoyo (digital), certificado y coffeebreaks.

## 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.
- Se requiere asistir al 80% de las clases para recibir certificado.



INSTITUTO DE FINANZAS  
DE SANTO DOMINGO

**CONTACTO:**

**[INFO@IFISD.COM](mailto:INFO@IFISD.COM)**

**TELÉFONO/WAPP 829.946.0983**