



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*
	<small>*10% descuento al inscribir tres o más participantes de una institución.</small>
Incluye:	Material de apoyo (digital), certificado y coffebreaks.

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

TELÉFONO/WAPP 829.946.0983