



INSTITUTO DE FINANZAS
DE SANTO DOMINGO

CURSO-TALLER
APLICACIONES DE SIMULACIÓN
MONTECARLO PARA LAS
FINANZAS

Abril 2023

DIRIGIDO A

Especialistas en inversión, traders, gerentes de tesorería, administradores de fondos, gerentes financieros, especialistas en riesgos y personas interesadas con conocimientos previos de matemática financiera y finanzas.

OBJETIVO GENERAL

Dotar a los participantes de los conocimientos teórico-prácticos para implementar la metodología Simulación Montecarlo en la toma de decisiones financieras.

METODOLOGÍA

La duración del programa es de 12 horas, dividido en sesiones de 3 horas que incluyen presentaciones y ejercicios prácticos incluyendo casos que serán desarrollados en Excel.

CONTENIDO DEL PROGRAMA

TEMA I: Introducción a la Simulación Montecarlo

- El proceso de simulación y los números pseudo aleatorios.
- Ley de los grandes números y teorema central del límite.
- Muestreo estadístico y los usos de data sintética.
- Ventajas y desventajas de la SM.
- Distribuciones probabilísticas y sus momentos.
- Herramientas de SM.

TEMA II: Aplicaciones en Finanzas

- Valoración
- Correlaciones
- Volatilidad
- Valor en Riesgo

CONTENIDO DEL PROGRAMA



TEMA III: Aplicaciones para Simulación de Tasas de Interés

- Estacionariedad y reversión a la media.
- Modelos de Tasas de Interés:
 - Vasicek
 - Cox, Ingersoll & Ross (CIR)
- Modelación de la TIPP RD.
- Modelación de la Curva de Rendimientos .

TEMA IV: Aplicaciones en Renta Fija

- VaR por Simulación Montecarlo para bonos locales.
- Conformación y optimización de portafolios de renta fija con instrumentos locales.

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.

INFORMACIÓN GENERAL

| | |
|----------------------------------|--|
| Fecha: | 18, 20, 25 y 27 de abril. |
| Horario: | De 6:00 p.m. a 9:00 p.m. |
| Duración: | 12 horas |
| Modalidad: | Híbrida (3 sesiones presenciales + 1 sesión virtual) |
| Inversión: | US\$495.00* *10% descuento al inscribir tres o más participantes de una institución. |
| Incluye: | Material de apoyo en formato digital y certificado de participación. |
| Nivel de la capacitación: | Intermedio |

OTRAS INFORMACIONES

- Se recomienda que los participantes cuenten con una formación matemática de nivel medio/superior y tener experiencia profesional dentro de instituciones del sector financiero.
- Los participantes deben contar con una laptop equipada con MS Excel.
- Los ejercicios 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 de participación.



Para inscripciones completar el formulario de inscripción mediante 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



INSTITUTO DE FINANZAS
DE SANTO DOMINGO

CONTACTO:

INFO@IFISD.COM

TELÉFONO/WAPP 829.946.0983