



INSTITUTO DE FINANZAS
DE SANTO DOMINGO

CURSO-TALLER

VALUE AT RISK (VaR)

Agosto- Septiembre 2023

CURSO-TALLER VALUE AT RISK (VaR)



DIRIGIDO A:

Profesionales de las áreas de tesorería y riesgos de bancos, puestos de bolsa, fondos de pensiones, aseguradoras, 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 teórico-prácticos en la metodología más importante de medición de riesgo de mercado. Los participantes aprenderán la trascendencia del VaR, sus características, ventajas y desventajas. Así mismo, se desarrollarán las habilidades necesarias para implementar esta metodología en portafolios conformados por instrumentos locales e internacionales.

CONTENIDO DEL PROGRAMA

Tema I. Caracterización del Riesgo de Mercado

- Momentos de la distribución
- Tipos de distribución
- Caracterización de una distribución
- Matriz Varianza-Covarianza

Tema II. Metodología y tipos de modelos VaR

- La metodología del VaR
- VaR Paramétrico
- VaR Histórico
- VaR Condicional
- VaR Montecarlo
- Stressed VaR
- Backtesting del VaR

Tema III. Aplicaciones de Value at Risk

- Portafolios de renta fija
- VaR para instituciones de intermediación financiera con ALM
- VaR de Liquidez
- Stress Testing

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:	29, 31 de agosto, 05 y 07 septiembre, 2023
Horario:	De 6:00pm a 9:00pm
Duración:	12 hrs
Modalidad:	Presencial 100%
Inversión:	US\$645.00 US\$580.00 (precio especial hasta el 11 de agosto)
Incluye:	Material de apoyo en formato digital y certificado de participación
Nivel de la capacitación:	Intermedio

Requisitos:

- Disponer de computadora equipada con MS Excel.
- Se recomienda que los participantes cuenten con una formación matemática de nivel medio/superior y tener experiencia profesional dentro de instituciones del sector financiero.



Para inscripciones favor 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