



INSTITUTO DE FINANZAS  
DE SANTO DOMINGO

# **CURSO-TALLER**

# **ADMINISTRACION DE RIESGOS**

# **FINANCIEROS**

Septiembre-Octubre  
2023

## **CURSO-TALLER**

# **ADMINISTRACION DE RIESGOS FINANCIEROS**

### **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 y participantes del sector financiero en general.

### **OBJETIVOS:**

Dotar a los participantes de los conocimientos teóricos-prácticos en la identificación, medición y cuantificación de los riesgos financieros, considerando las mejores prácticas y las particularidades del mercado local.

## CONTENIDO DEL PROGRAMA

### Tema I: Conceptos de Estadística Matemática y Probabilidad

- Fundamentos de probabilidad
- Conceptos de independencia estadística
- Medidas de tendencia central y medidas de dispersión
- Tipos de distribuciones y sus aplicaciones
- Media, varianza, covarianza y correlación
- Hipotesis testing

### Tema II: Riesgo de Crédito (Individual y de Portafolio)

- Modelo de Merton
- Matriz de migración
- Z-Score de Altman
- PD, LGD, EAD
- EL y UL crédito individual
- EL y UL cartera de crédito Exposición Esperada (EE)
- Exposición futura potencial (PFE)
- Exposición Positiva Esperada (EPE)
- Exposición Máxima futura potencial (Max PFE)
- Exposición Esperada Efectiva (EEE)
- Exposición Positiva Esperada Efectiva (EEPE)
- CVA y CVA spread
- DVA y CVA Bilateral
- VaR de una cartera de crédito

## CONTENIDO DEL PROGRAMA (CONT.)

### **Tema III: Riesgo de Mercado, Stress & Back Testing**

- Fuentes del Riesgo de Mercado en una institución financiera
- VaR y CVaR
- Prueba de Kupiec

### **Tema IV: Riesgo de Liquidez**

- Gestión del riesgo de liquidez
- Ratio de cobertura de liquidez
- Modelos de brecha de liquidez
- Modelos de recuperación de liquidez
- Riesgo de liquidez y su impacto en el balance

## PERFIL DE LOS FACILITADORES



### **IVANKA GONZÁLEZ**

Economista con maestría en Gestión de Riesgos y Tesorería por la Pontificia Universidad Católica Madre y Maestra (PUCMM). Maestría en Economía y Finanzas por la Universidad de Navarra y formación en Data Science por la Universidad Johns Hopkins.

Cuenta con más de 12 años de experiencia en el área de Riesgos Financieros y Estudios Económicos, actualmente ocupa la posición de 2do. VP Riesgo de Mercado y Liquidez en el Banco Múltiple BHD.

### **JONATHAN MEDINA**

Licenciado en Economía por la Pontificia Universidad Católica Madre y Maestra (PUCMM) con maestría en Ciencias Económicas por Utah State University y postgrado en Finanzas Corporativas por el INTEC.

Posee más de 15 años de experiencia en la gestión de riesgos y portafolios bancarios, ocupando actualmente la posición de VP de Administración Integral de Riesgos en Banesco Banco Múltiple.

### **LUIS BARANDA, CFA**

Licenciado en Economía de la Universidad de Buenos Aires (UBA), cuenta con una maestría en Finanzas de la Universidad Torcuato Di Tella y es CFA Charterholder. Cuenta con 15 años de experiencia en el sector financiero en áreas de Riesgo y Tesorería para Latinoamérica. Actualmente es ALM Treasury Trader en Banco Itaú Paraguay. Posee más de 7 años de experiencia docente en diversas instituciones con enfoque en las áreas de Economía y Finanzas.

## INFORMACIÓN GENERAL



<b>Fecha:</b>	Del 19 de septiembre al 12 de octubre, 2023 (Martes y jueves)
<b>Horario:</b>	De 6:00 p.m. a 9:00 p.m.
<b>Duración:</b>	24 hrs.
<b>Modalidad:</b>	Híbrida (ver calendario)
<b>Inversión:</b>	USD595.00  *10% descuento al inscribir tres o más participantes de una institución.
<b>Incluye:</b>	Material de apoyo en formato digital, coffeebreaks y certificado de participación.
<b>Nivel de la capacitación:</b>	Fundamentos

## OTRAS INFORMACIONES

- Cada participante debe disponer de computadora equipada con MS Excel y acceso a plataforma Zoom.
- Es recomendable que los participantes cuenten con una formación matemática de nivel medio/superior y tener experiencia profesional dentro de instituciones del sector financiero.
- Se requiere asistir al 80% de las clases para recibir el certificado de participación.

# Calendario

Sesión	Contenido	Duración	Horario	Fechas	Modalidad	Docente
1	Tema I. Conceptos de Estadística Matemática y Probabilidad	3	De 6:00pm a 9:00pm	19 de septiembre	Presencial	Ivanka González
2	Continuación tema I.	3	De 6:00pm a 9:00pm	21 de septiembre	Virtual	Ivanka González
3	Tema II. Riesgo de Crédito (Individual y de Portafolio).	3	De 6:00pm a 9:00pm	26 de septiembre	Presencial	Jonathan Medina
4	Continuación Tema II	3	De 6:00pm a 9:00pm	28 de septiembre	Presencial	Jonathan Medina
5	Tema III. Riesgo de Liquidez	3	De 6:00pm a 9:00pm	03 de octubre	Presencial	Ivanka González
6	Continuación tema III.	3	De 6:00pm a 9:00pm	05 de octubre	Virtual	Ivanka González
7	Tema IV. Riesgo de Mercado, Stress & Back Testing	3	De 6:00pm a 9:00pm	10 de octubre	Virtual	Luis Baranda
8	Continuación tema IV.	3	De 6:00pm a 9:00pm	12 de octubre	Virtual	Luis Baranda



Para inscripciones favor completar el formulario de inscripción mediante enlace debajo y enviar a:  
[info@ifisd.com](mailto: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](mailto:info@ifisd.com)



INSTITUTO DE FINANZAS  
DE SANTO DOMINGO

**CONTACTO:**

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

**TELÉFONO 829.946.0983**