



INSTITUTO DE FINANZAS  
DE SANTO DOMINGO

# **CURSO-TALLER**

## **GESTIÓN DE LA CARTERA DE INVERSIONES BAJO EL ENFOQUE DE VALOR RAZONABLE**

EN ALIANZA CON



Noviembre 2023

# GESTIÓN DE LA CARTERA DE INVERSIONES BAJO EL ENFOQUE DE VALOR RAZONABLE



## DIRIGIDO A:

Profesionales de las áreas de tesorería, riesgos y finanzas de bancos, asociaciones de ahorros y préstamos, reguladores, proveedoras de precios y participantes del sector financiero en general.

## OBJETIVOS:

- Conocer todos los aspectos relevantes que afectan a las carteras de inversiones bajo el esquema de valor razonable.
- Evaluar las metodologías de valoración y proyectar el impacto económico de múltiples escenarios.
- Conocer las diferentes metodologías utilizadas en la construcción de un vector de precios.

# CONTENIDO DEL PROGRAMA



## TEMA I: El modelo de Valor Razonable y su impacto en los EEFF

- Modelo de negocio bajo NIFF 9
- Carteras y cuentas del portafolio de inversión
- Registro de operaciones y el proceso de Mark to Market (MTM)
- Disyuntivas entre las diferentes carteras
- Riesgo de liquidez vs. riesgo de precio

## TEMA II. Metodologías para generar un vector de precios

- Insumos de información necesarios
- Curvas de rendimientos
- Metodologías directas
- Metodologías indirectas
- Bandas de volatilidad
- Bondad de ajuste de las metodologías y backtesting
- Aplicaciones en Excel

# CONTENIDO DEL PROGRAMA



## TEMA III. Impacto económico del riesgo de tasa de interés

- Caracterización del riesgo de tasa de interés de la cartera de inversión bajo el esquema de valor razonable
- Análisis de sensibilidad de la cartera de inversión
- Análisis de escenarios de la cartera de inversión
- Impacto económico en los EEFF
- Estrategias de diversificación del impacto económico
- Aplicaciones en Excel

# PERFIL DE LOS FACILITADORES



## **ALERSO PIMENTEL, CFA, CQF**

Economista egresado del INTEC con postgrado en Banca y Finanzas Cuantitativas por la Universidad del País Vasco, certificado como Chartered Financial Analyst (CFA) y certificado en Finanzas Cuantitativas (CQF). Cuenta con más de 12 años de experiencia en el sector financiero y mercado de valores. Actualmente se desempeña como CEO de QuanTech y Managing Director de Mercado de Capitales en Yunque Capital. Posee 10 años de experiencia docente, con especial enfoque en temas relacionados al mercado de capitales, finanzas cuantitativas y gestión de riesgos financieros.

# PERFIL DE LOS FACILITADORES



## JAVIER LEÓN, MSF

Máster en Finanzas de Boston College, cuenta con casi dos décadas de experiencia en el sector financiero, negociando en mercados locales e internacionales.

Actualmente es Tesorero de Citi para Rep. Dominicana y Haití. Posee más de 15 años de experiencia docente, con especial enfoque en mercados financieros y la gestión de tesorería.

# INFORMACIÓN GENERAL



**Fecha:** 13, 15, 20, 22, 27 y 29 de noviembre

**Horario:** De 6:00pm a 8:00pm

**Duración:** 12 hrs.

**Modalidad:** Virtual (Zoom)

**Inversión:** US\$545.00

**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](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/WAPP 829.946.0983**