



Instituto de Finanzas
de Santo Domingo

**DIPLOMADO
ADMINISTRACIÓN DE
RIESGOS
FINANCIEROS**

Mayo 2025

DIPLOMADO ADMINISTRACIÓN 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:

Proporcionar a los participantes los conocimientos teóricos y prácticos necesarios para identificar, medir y cuantificar los riesgos financieros, integrando las mejores prácticas y adaptándose a 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
- Hipótesis 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.

PERFIL DE LOS FACILITADORES



GILBERT MÉNDEZ

Licenciado en Economía con Máster en Gestión de Riesgos y Tesorería, ambos títulos otorgados por la Pontificia Universidad Católica Madre y Maestra (PUCMM). Certificado como Chartered Financial Analyst (CFA) y como Financial Risk Manager (FRM). Cuenta con más de 12 años de experiencia en la banca dominicana enfocado en las áreas de Tesorería y Riesgos. Actualmente se desempeña como Gerente de División de Análisis de Riesgos Financieros en AFP Popular. Posee experiencia docente en diversas instituciones orientado a las áreas de Riesgo y Tesorería.

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. Cuenta con más de 15 años de trayectoria en el sector financiero. Durante 7 años se desempeñó como Director de Riesgos en Primma Valores Puesto de Bolsa. Actualmente, ocupa la posición de 2do. Vicepresidente de Analítica Avanzada en Banco BHD, liderando proyectos clave en el ámbito de la inteligencia analítica.

INFORMACIÓN GENERAL

Fecha:	Del 12 de mayo al 23 de junio, 2025. (Lunes y Miércoles)
Modalidad:	Híbrida (ver calendario)
Horario:	De 6:00pm a 8:00pm (sesiones virtuales) De 6:00pm a 9:00pm (4 sesiones presenciales)
Lugar:	Homewood Suites, Av. Churchill (presenciales)/ Zoom
Duración:	32 hrs.
Inversión:	USD645.00 *10% descuento al inscribir tres o más participantes de una institución.
Incluye:	Material de apoyo en formato digital, coffeebreaks y certificado de participación.
Nivel de la capacitación:	Intermedio

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 en instituciones del sector financiero.
- Se requiere asistir al 80% de las clases para recibir el certificado de participación.

CALENDARIO

Diplomado en Administración de Riesgos Financieros

Sesión	Contenido	Duración	Horario	Fechas	Modalidad
1	Tema I. Conceptos de	3	De 6:00pm a 9:00pm	Lunes 12 de mayo	Presencial
2	Estadística Matemática y	2	De 6:00pm a 8:00pm	Miércoles 14 de mayo	Virtual
3	Probabilidad	2	De 6:00pm a 8:00pm	Lunes 19 de mayo	Virtual
4	Tema II. Riesgo de Crédito (Individual y de Portafolio)	3	De 6:00pm a 8:00pm	Miércoles 21 de mayo	Virtual
5		2.5	De 6:00pm a 8:00pm	Lunes 26 de mayo	Virtual
6		2.5	De 6:00pm a 9:00pm	Miércoles 28 de mayo	Presencial
7	Tema III. Riesgo de Liquidez	2.5	De 6:00pm a 8:00pm	Lunes 02 de junio	Virtual
8		3	De 6:00pm a 9:00pm	Miércoles 04 de junio	Presencial
9		2.5	De 6:00pm a 8:00pm	Lunes 09 de junio	Virtual
10	Tema IV. Riesgo de Mercado, Stress & Back Testing	2	De 6:00pm a 8:00pm	Miércoles 11 de junio	Virtual
11		2	De 6:00pm a 8:00pm	Lunes 16 de junio	Virtual
12		2	De 6:00pm a 8:00pm	Miércoles 18 de junio	Virtual
13		3	De 6:00pm a 9:00pm	Lunes 23 de junio	Presencial



CONTACTO:

info@ifisd.com

Tel./Whatsapp 829.946.0983



ifi.sd



Instituto de Finanzas de Santo Domingo



InstitutodefinanzasSD