



CURSO-TALLER

Gestión de la Cartera de Inversiones bajo el Enfoque de Valor Razonable

EN ALIANZA CON



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.

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: Sábados 14, 21, 28 de junio y 5 de julio

Horario: De 9:00am a 12:00pm

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:

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



CONTACTO:

info@ifisd.com

Tel./Whatsapp 829.946.0983



Ifi.sd



Instituto de Finanzas de Santo Domingo



InstitutodefinanzasSD