

CURSO LAS MEJORES PRÁCTICAS EN LA GESTIÓN DEL RIESGO DE CRÉDITO

EXPOSITOR DR. JORGE OTERO RODRÍGUEZ

FECHA Del 29 al 30 de septiembre del 2010

LUGAR Salón de capacitación de ABA

Bajo el Acuerdo suscrito con la Fundación General
de la Universidad Autónoma de Madrid (FGUAM) y la ABA

IADE
UNIVERSIDAD AUTÓNOMA DE MADRID



ABA

Asociación de Bancos Comerciales
de la República Dominicana



OBJETIVOS

El curso analizará las mejores prácticas internacionales relacionadas con la gestión del riesgo crediticio, los sistemas de calificación crediticia, los modelos internos de riesgo, las técnicas disponibles para su elaboración y la descripción de metodologías de prueba de estrés y valor en riesgo, así como la determinación de las pérdidas esperadas, el capital económico y el capital regulatorio según los acuerdos de Basilea.

EXPOSITOR

PROFESOR DR. JORGE OTERO RODRÍGUEZ

Posee el grado de Doctor en Economía y Administración de Empresas de la Universidad Autónoma de Madrid, España, donde obtuvo el Premio Extraordinario de Doctorado.

Actualmente es Profesor en Dirección y Gestión de Banca en la Maestría de Banca de la Universidad Autónoma de Madrid y Profesor en Dirección Financiera y Economía de la Empresa en la Licenciatura de Economía y Administración de esta Universidad.

En adición a su labor docente, se desempeña como alto ejecutivo en una de las principales instituciones bancarias de España.





PROGRAMA

1er. Día CONCEPTOS BÁSICOS

- Definición del riesgo de crédito.
- Marco general de la gestión del riesgo de crédito.
- Requerimientos de capital por riesgo de crédito según los Acuerdos de Basilea.
- El método estándar.
- Los métodos internos.

2do. Día MEDICIÓN DE LA EXPOSICIÓN AL RIESGO DE CRÉDITO

- Riesgo individual de un crédito.
- Riesgo soberano y riesgo de crédito.
- Ratings externos e internos.
- Métodos cuantitativos para valorar el riesgo de insolvencia (Default-Risk –el modelo unifactorial).
- Pérdida esperada en caso de insolvencia (Loss Given Default).
- Cartera de Créditos y pérdidas esperadas.
- Pérdidas no esperadas.
- Severidad.
- Recuperación.

3er. Día RIESGOS DE CONTRAPARTE

- Medición del riesgo de contraparte.
- Requerimientos de capital por el riesgo de contraparte.
- Credit Default Swaps.

PRUEBAS DE STRESS Y DE VaR

- Descripción de los metodologías.
- Planteamientos de casos aplicados al riesgo de crédito.

CASOS PRÁCTICOS



ORIENTACIÓN DEL CURSO

El curso está orientado a la alta dirección de las instituciones financieras y al personal relacionado con el otorgamiento de préstamos, el análisis de crédito, la administración, control y manejo de los riesgos crediticios, y en general al personal de las diferentes áreas de finanzas, contabilidad, auditoría y negocios.



Emitido por IADE de la
Universidad Autónoma de
Madrid, España.

CERTIFICADO DE PARTICIPACIÓN



VALOR DE LA INSCRIPCIÓN

El valor de la inscripción es de US\$2,200 por participante, incluye:

- Materiales del Curso
- Certificado de participación
- Refrigerios

Cupo Limitado

PARA INSCRIPCIONES Y RESERVAS

Alexandra Espinal y/o Indira Jiménez
Asociación de Bancos Comerciales de la República Dominicana, Inc. (ABA)
Tel: 809-541-5211 al 19/809-541-9171
Mail: caespinal@aba.org.do y ijimenez@aba.org.do