

RISK MANAGEMENT



FORMAÇÃO AVANÇADA

SAVE THE DATE

25, 26 E 27
MARÇO 2020*



INFORMAÇÕES

Catarina Santos

c.santos@ifb.pt

+351 217 916 293



* As formações calendarizadas funcionam com um número mínimo e máximo de formandos, pelo que, a realização das mesmas encontra-se sujeita a confirmação.

RISK MANAGEMENT

DOCENTES

Carlos Rafael Branco: Diretor Adjunto da Sociedade Gestora dos Fundos de Pensões do Banco de Portugal

Gabriel Andrade: Diretor do Departamento de Gestão de Risco do Banco de Portugal

Maria da Luz Miranda: Especialista na área Bancária de Auditoria, Risco Operacional e Controlo Interno (Consultora IFB)

DESTINATÁRIOS

Membros das Comissões Executivas e de Auditoria; Diretores, Chefias Intermédias e Quadros Técnicos das Áreas de Risco; Titulares de Funções Essenciais

DURAÇÃO: 3 dias / 21 horas

HORÁRIO: 9h00–17h00

LOCAL: Av. Barbosa de Bocage, 87 - R/C, Lisboa

PREÇO: Associado APB 946€; Tabela Geral 1.088€



FORMAÇÃO AVANÇADA

1º DIA

Módulo I

O SISTEMA DE CONTROLO INTERNO

- Aspectos metodológicos do sistema de controlo interno da banca: enfoque de Basileia
- Identificação de deficiências, recomendações e planos de ação
- O modelo das três linhas de defesa
- Os pilares do sistema de controlo interno: a função de auditoria interna, a função de *compliance* e a função de gestão do risco
- O papel da Comissão de Auditoria

Módulo II

A GESTÃO DE RISCO E OS PRINCÍPIOS DE BOM GOVERNO

- O reforço do modelo de governação: aplicação dos princípios básicos
- Adequação da estrutura organizativa a uma gestão de risco eficaz
- A função do CHIEF RISK OFFICER (CRO)
- O papel das comissões do Conselho
- A Comissão de nomeações e remunerações
- A Comissão de risco: composição e funções
- A importância da independência e da segregação de funções: gestão vs supervisão

- Os riscos bancários críticos: mercado, taxa de juro, taxa de câmbio, operacional, de crédito, liquidez, *compliance*, branqueamento de capitais e financiamento do terrorismo entre outros
- As novas exigências da regulação e *reporting*: capital, liquidez, IFRS9

Módulo IV

O PROCESSO DE TRANSFORMAÇÃO DA GESTÃO DO RISCO

- Modelos de quantificação dos diferentes tipos de risco: *gap*, duração, convexidade, VaR, rácios de liquidez
- Os NPLs e NPEs: um problema a resolver
- Grau de concentração da carteira: a importância da diversificação
- O “*trade-off*” risco – rentabilidade: probabilidade e impacto económico
- A importância do capital: solvabilidade e perfil de risco
- Definição do NÍVEL DE TOLERÂNCIA AO RISCO e as suas implicações
- Alinhamento dos indicadores de risco com o nível de apetite ao risco do Banco
- Risco, Rentabilidade e robustez financeira: as 3 RRR fundamentais da gestão bancária
- Discussão de um caso prático

2º DIA

Módulo III

A GESTÃO DE RISCO COMO PARTE DA ESTRATÉGIA

- A definição da estratégia num contexto de transformação do sector financeiro
- A gestão do risco como objetivo estratégico
- Análise das diferentes etapas do Sistema de Gestão de Riscos: Identificação, Avaliação, Acompanhamento e Controlo

3º DIA

Módulo V

GOVERNAÇÃO INTERNA DA GESTÃO DE RISCO (CASOS PRÁTICOS)

- Identificar lacunas ou entraves (*gap analysis*)
- Estabelecer prioridades de ação
- Construir desenho da arquitetura de gestão de risco
- Elaborar proposta de estrutura de governação interna
- Apresentação de propostas e *challenging*



FULL MEMBER OF

