



# GESTÃO DE ATIVOS E PASSIVOS

FORMAÇÃO AVANÇADA

FORMAÇÃO  
ONLINE POR  
VIDEOCONFERÊNCIA

7, 11, 14, 18, 21, 25 E 28 DE OUTUBRO DE 2021



EDIÇÃO  
outubro 2021\*

## INFORMAÇÕES

Catarina Santos

c.santos@ifb.pt

+351 217916293

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



**DESTINATÁRIOS:** Diretores, Chefias Intermédias e Quadros Técnicos das áreas ligadas à gestão dos riscos de taxa de juro e de liquidez, Tesouraria, Mercados Financeiros, Auditoria, Titulares de Funções Essenciais.

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

**DURAÇÃO:** 7 dias / 21 horas

**HORÁRIO:** das 17H00 às 20H00

**PREÇÁRIO:**

|                | Associados | Tabela Geral |
|----------------|------------|--------------|
| Curso Completo | 950 €      | 1 092 €      |

FORMAÇÃO AVANÇADA



## PROGRAMA

### FUNDAMENTOS E CONCEITOS ESSENCIAIS

- Regulação bancária (Basileia e CRD/CRR)
- Princípios de gestão do risco de liquidez
- Desafios da gestão centralizada do risco de liquidez
- Interações / sinergias / conflitos na gestão dos riscos de liquidez e de taxa de juro

### RISCOS

- Principais riscos
- Repercussões reputacionais
- Risk Appetite Framework

### GESTÃO FINANCEIRA E GESTÃO ESTRATÉGICA

- Visão, Missão e Valores
- ALM
- Gestão financeira

### PROCESSO ALM

- Valor acrescentado
- Contexto – Processo – reavaliação
- Aplicação

### OBJETIVOS E MÉTRICAS

- Objetivos (dimensão interna e externa)
- Desafios regulamentares
- Métricas regulamentares

### MEDIÇÃO E GESTÃO (CAMELS, GAP, EVE, NEV)

- Medição vs. gestão
- Sensibilidade
- Margem financeira
- Perspetivas de curto prazo e de longo prazo

### POLÍTICA DE ALM

- Quadro de referência
- Governação
- *Red flags*



FULL MEMBER OF

