

As taxas de referência do mercado utilizadas nas operações Interbancárias e com Clientes, concretamente a EONIA e a EURIBOR estão a ser submetidas a um processo de reformulação.

O impacto das alterações não se esgota na mudança ocorrida em 2 de outubro de 2019.

EURIBOR e EONIA

EVOLUÇÃO RECENTE, FUTURA E IMPACTO

SAVE THE DATE



INFORMAÇÕES

Teresa Corales
t.corales@ifb.pt

+351 217 916 278

Av. da República, 35 – 8º
1050-186 Lisboa



FORMAÇÃO INTERMÉDIA

MERCADOS
FINANCEIROS

EURIBOR e EONIA

EVOLUÇÃO RECENTE, FUTURA E IMPACTO

DESTINATÁRIOS

Quadros e técnicos das áreas financeira e de risco relacionados com carteiras de derivativos e títulos.

Quadros e técnicos que se encontrem ligados aos processos de liquidação de transações financeiras e de valorização dos elementos do balanço.

Colaboradores que possam direta ou indiretamente ter interesse em acompanhar o processo de evolução da Euribor e Eonia.

HORÁRIO: 09h00 – 13h00

DURAÇÃO: 4 Horas

LOCAL: Av. Barbosa du Bocage, 87 – r/c - Lisboa

PREÇO: Associado APB – 215 € | Tabela Geral – 250 €

ENQUADRAMENTO

O curso EURIBOR e EONIA pretende levar ao conhecimento dos participantes a origem e conteúdo dos desenvolvimentos já ocorridos, bem como as próximas etapas de evolução destas taxas de juro de referência.

É feita uma abordagem das implicações destas alterações sobre os diversos instrumentos financeiros, identificando as necessidades de adaptação dos mesmos e dos respetivos modelos de valorização.

OBJETIVOS:

- Apresentar as alterações que já ocorreram na Euribor e Eonia
- Enunciar os próximos passos da evolução da Euribor e Eonia
- Identificar o impacto das alterações sobre os processos operacionais de tratamento dos produtos financeiros
- Analisar o efeito das alterações sobre a valorização da carteira de produtos financeiros

PROGRAMA

1. Definições da Euribor
2. Regulamento (UE) 2016/1011
3. Euribor
4. RFR Group
5. €STR
6. €STR e Eonia
7. Transição da Eonia para a €STR
 - Produtos cash
 - Derivados
 - Modelos de valorização
8. Últimos desenvolvimentos da Euribor
 - Cláusulas *fall-back*
 - Impacto contabilístico
 - Gestão do risco



FORMAÇÃO INTERMÉDIA

MERCADOS
FINANCEIROS



FULL MEMBER OF

