

**EXECUTIVE
EDUCATION**



FORMAÇÃO AVANÇADA

FORMAÇÃO
ONLINE POR
VIDEOCONFERÊNCIA

GESTÃO DE ATIVOS E PASSIVOS



EDIÇÃO
A agendar*

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 | 1 078 € | 1 240 € |

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

