

**EXECUTIVE  
EDUCATION**



FORMAÇÃO AVANÇADA

FORMAÇÃO  
ONLINE POR  
VIDEOCONFERÊNCIA

# Modelização, Quantificação e Gestão de Riscos na Banca



➔ **2024**  
**19 E 20 SET\***

**INFORMAÇÕES**

**Catarina Santos**

[c.santos@ifb.pt](mailto: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.

# Modelização, Quantificação e Gestão de Riscos na Banca



FORMAÇÃO AVANÇADA



## DESTINATÁRIOS:

Quadros médios e superiores das seguintes áreas de instituições financeiras: gestão de risco, compliance, auditoria interna, contabilidade e concessão de crédito.

## HORÁRIO:

19 set – 09h00 – 13h00  
20 set – 09h00 – 11h00

## OBJETIVOS:

- Identificar e caracterizar os principais riscos na Banca;
- Apresentar metodologias alternativas e técnicas de análise para a quantificação e gestão de riscos na Banca.

## PREÇÁRIO:

Associados APB: 504 € | Tabela Geral: 580 €

**DURAÇÃO:** 6 horas

## FORMADORES

### Carlos Rafael Branco

Doutor em Gestão, na especialidade de Finanças, mestre em Economia Monetária e Financeira e licenciado em Economia. Exerceu funções nos domínios da gestão de risco e das finanças empresariais. Nos últimos 18 anos, tem desenvolvido a carreira profissional no Banco de Portugal, nas áreas da supervisão bancária, da gestão de risco e da gestão de fundos de pensões. Colabora com a Associação Portuguesa de Bancos, desde 1995. Mantém ligação à academia, enquanto docente (professor auxiliar) e investigador na área das Finanças, em particular sobre modelos de risco de crédito, sobre sistemas de notação e sobre sustentabilidade. Tem participado em grupos de trabalho nacionais e internacionais (Comissão Europeia, Comité Europeu de Supervisão Bancária, Banco Central Europeu, Banco de Pagamentos Internacionais), em matérias ligadas à regulação da atividade bancária, tema sobre o qual tem apresentado comunicações em conferências e seminários. É membro efetivo da Ordem dos Economistas, onde já desempenhou funções no Conselho de Profissão.

### Jorge Belo de Carvalho

Licenciado em gestão de empresas pela Universidade Católica Portuguesa e Chartered Financial Analyst (CFA).

Possui vasta experiência profissional na área da Banca, tendo exercido diferentes funções: dealer, *treasurer*, *risk advisory*, vendas; estruturação de instrumentos derivados e vendas.

Desde 2007 trabalha no desenvolvimento de modelos de valorização de ativos e fornecimento de valorizações, desenho de sistemas de gestão de risco e *reporting*.

Entre os seus tópicos de especialização incluem-se, nomeadamente, gestão do risco e de liquidez, ALM, liquidez e gestão de posições cambiais; taxa de juro, Avaliações e modelação de VaR de crédito, IRRBB, relatórios de risco regulatório.

## PROGRAMA

1. Principais Riscos na Banca
2. Avaliação de riscos não financeiros
3. Pilar 2 (SREP)
4. Análises de Sensibilidade e Testes de Esforço
5. Avaliação e Quantificação de Risco de Crédito – os modelos de Scoring e Rating
6. Método das Notações Internas - critérios de elegibilidade
7. Detalhes sobre os Parâmetros de Risco de Crédito - PD, LGD, EAD e CCF



FULL MEMBER OF

