

EXECUTIVE EDUCATION



FORMAÇÃO AVANÇADA

FORMAÇÃO ONLINE POR VIDEOCONFERÊNCIA

GESTÃO DE ATIVOS E PASSIVOS



2025
06 A 27 NOV*

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	1 100 €	1 264 €

FORMAÇÃO AVANÇADA



PROGRAMA

RISCOS E REGULAÇÃO

- Riscos financeiros e não-financeiros
- Principais riscos
- Regulação (Basileia e CRD/CRR)

FUNDAMENTOS E CONCEITOS ESSENCIAIS

- Gestão do risco de liquidez
- Gestão do risco de taxa de juro
- Interações / sinergias / conflitos na gestão dos riscos de liquidez e de taxa de juro

GOVERNAÇÃO E POLÍTICA

- Governação
- Política
- ALCO

PROCESSO ALM

- Valor acrescentado
- Contexto – Processo – reavaliação
- Objetivos e métricas

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

- Perspetivas de curto prazo e de longo prazo
- Instrumentos e técnicas
- Margem financeira

CONTINGÊNCIA

- *Risk Appetite Framework*
- *Red flags*
- Planos de liquidez e financiamento

CASOS PRÁTICOS



FULL MEMBER OF

