Derivados OTC – EMIR e Documentação ISDA

O mercado global de derivados OTC atingiu em 2024 um valor estimado 20,160 milhões de dólares, e estima-se que continue a crescer 3% ao ano até ao final da década. Os derivados OTC continuam a ser um instrumento essencial para gerir risco pelas instituições de crédito, sociedades financeiras, seguradoras e empresas.
Na sequência da crise financeira, o EMIR introduziu diversos mecanismos com o intuito de promover a transparência do mercado de balcão.
A documentação atualizou-se, e os contratos standard ISDA permaneceram centrais na negociação destes instrumentos.

SAVE THE DATE
2026
A agendar
*

INFORMAÇÕES
Ana Margarida Soromenho
a.m.soromenho@ifb.pt
+351 217 916 274**

FORMAÇÃO INTERMÉDIA

MERCADOS FINANCEIROS



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

Derivados OTC – EMIR e Documentação ISDA

DESTINATÁRIOS:

Advogados, colaboradores de instituições financeiras, reguladores e empresas, permitindo compreender os conceitos fundamentais da negociação e documentação de derivados, sendo especialmente relevante para:

- advogados, na assessoria à negociação e contratação de derivados;
- técnicos (quadros médios e superiores) de instituições financeiras e empresas, interessados em compreender a contratação de instrumentos de gestão ou tomada de risco;
- técnicos responsáveis por reporte, conformidade e auditoria (interna e externa) que pretendam compreender o papel dos derivados na gestão de risco e os requisitos legais na sua documentação;
- gestores responsáveis pelo negócio que pretendam conhecer o papel dos derivados na gestão de risco e a forma adequada de documentar as operações.

LOCAL:

Avenida Barbosa du Bocage, 87, r/c - Lisboa

DURAÇÃO: 05h30

HORÁRIO: 09h00 – 12h30 | 14h00 – 16h00

PREÇO: Associado APB: 306 € | Tabela Geral: 352 €



FORMAÇÃO INTERMÉDIA

MERCADOS FINANCEIROS

OBJETIVOS:

A formação permitirá compreender o quadro regulamentar, assim como a estrutura documental ISDA, incluindo o ISDA Master Agreement e documentação que regula prestação de margem.

Quais as questões relevantes na negociação e como documentar os acordos celebrados e suas especificidades.

Uma formação interativa, onde serão discutidos casos práticos.

FORMADORA: Sofia Santos Machado

Foi Administradora Executiva do Banco Português de Fomento, SA e da Caixa Central - Caixa Central de Crédito Agrícola Mútuo CRL, com os pelouros Conformidade e Jurídico. Anteriormente foi Sócia da Abreu Advogados, corresponsável da Área de Prática Direito Bancário e Financeiro e membro do Conselho de Administração.

Possui um LLM in Banking and Finance Law, Kings College, University of London

É Licenciada em Direito, Faculdade de Direito – Universidade de Lisboa.

PROGRAMA

1. **Mercado de Derivados**
   - Bolsa e OTC
   - OTC: Forward, Options, Swaps
   - IRS, Equity Swaps, Credit Default Swaps
2. **EMIR**
   - Contexto e objectivos
   - A obrigação de compensação e CCP
   - Repositórios e reporte
3. **Documentação ISDA – como funciona**
   - Master Agreement
   - Schedule
   - Collateral Documentation
   - ISDA Definitions
   - Confirmações
   - Protocolos
4. **Master Agreement**
   - Cláusulado
   - Como funciona netting e close-out netting
   - Como preencher o schedule
5. **Credit Support Documents**
   - Initial Margin
   - Variation Margin
   - Opções disponíveis – resultados práticos

Entidade Formadora Certificada dgert

FULL MEMBER OF EBTN EUROPEAN BANKING & FINANCIAL SERVICES TRAINING ASSOCIATION AISBL

Pedidos de Cancelamento:

- Só poderão dar origem ao reembolso total do valor pago, quando recebidos até 5 dias úteis antes da data de início do curso. A partir deste prazo, a inscrição será paga na totalidade, podendo, no entanto, o participante ser substituído por outro;
- Deverão ser efetuados por e-mail e rececionados pelo IFB dentro do prazo acima estabelecido.