

Requisitos de Capital e Exigências de Liquidez no Contexto da Supervisão

Objetivos Gerais

Este Curso tem como objetivo dotar os participantes de conhecimentos e de competências para melhor compreender a importância estratégica, de obrigações de reporte e validação de exigências ao nível do capital e da liquidez das Instituições de crédito.

Objetivos Específicos

No final deste Curso os participantes saberão:

- Compreender a essência das exigências dos acordos de Basileia;
- Conhecer o scope do ICAAP (capital) e do ILAAP (liquidez);
- Compreender o porquê destas medidas;

Destinatários

Este Curso destina-se a profissionais da área da gestão de riscos, profissionais com responsabilidades de reporte e de ligação a entidades supervisoras e, mais em geral, a profissionais ligados a áreas contabilísticas, financeiras ou de planeamento.

Carga Horária

12 Horas

Conteúdos Programáticos

Módulo I – O Controlo e Mitigação de Crises Sistémicas

- O risco sistémico;
- A necessidade de robustecimento do sistema financeiro;
- Os acordos de Basileia.

Módulo II – Requisitos/Exigências de Capital

- O financiamento das Instituições;
- O problema da alavancagem;
- A qualidade dos ativos;
- ICAAP

Módulo III – A Questão da Liquidez.

- A questão da confiança no sistema;
- Resistência ao stress;
- ILAAP;

Módulo IV- Debate, Conclusões e Encerramento