

GESTÃO DE RISCO DE INSTRUMENTOS DE CAPITAL

FORMAÇÃO
ONLINE

4 e 5/11/2024

Horário: 14h00 – 17h00

Formador: Pedro Barreirão

Supervisor bancário no Banco de Portugal e professor convidado na Universidade Europeia. Doutorado em Finanças pelo ISCTE-IUL, Pós-Graduado em Regulação Bancária pela NOVA SBE, Pós-Graduado em Contabilidade e Fiscalidade pelo ISCTE-IUL, Mestre em Finanças e Licenciado em Gestão pelo ISEG. Adicionalmente, concluiu as certificações CFA, FRM e CIPM. Tem um percurso profissional nas áreas de controlo de gestão, auditoria externa, recuperação de crédito e supervisão bancária.

OBJETIVOS

Desenvolver competências que permitam compreender a metodologia de gestão de instrumentos de capital.

RAZÕES PARA PARTICIPAR

Os instrumentos de capital têm riscos que podem resultar em perdas financeiras. Desta forma, torna-se elementar os contabilistas e investidores conhecer os riscos a que esse tipo de instrumentos está exposto para que a exposição ao risco possa ser gerida. Adicionalmente, o risco de instrumentos de capital pode ter um impacto material nas demonstrações financeiras, constituindo assim uma matéria de risco que os auditores devem compreender. Este curso foca as principais metodologias de gestão de risco de instrumentos de capital.

PROGRAMA

1. Medição de volatilidade;
2. Parâmetros e métodos de *Value at Risk*;
3. *Constant Proportion Portfolio Insurance*
4. Noções de diversificação.

DESTINATÁRIOS

Revisores Oficiais de Contas e seus colaboradores, consultores financeiros e outros técnicos e profissionais da área financeira.

PREÇO

ROC e Colaboradores: 84€

Outros Profissionais: 100€