

Plano de Cooperação do Banco de Portugal para 2025

Cursos e seminários com os Bancos Centrais dos Países de Língua Portuguesa (BCPLP)

Introdução à gestão de ativos e do risco

Curso introdutório, organizado pelo **Departamento de Mercados** e pelo **Departamento de Gestão do Risco**. Apresenta os principais conceitos e procedimentos relativos à gestão de reservas e ao enquadramento da gestão dos riscos inerentes à gestão de reservas e de outros ativos financeiros.

 3 a 5 de novembro

 Portugal

 Mín. 3 participantes

Programa preliminar:

- Acompanhamento de mercados (fundamentos, características dos mercados, definição de *benchmarks*, análise de indicadores económicos, expectativas e previsões sobre taxas de juro e de câmbio).
- Gestão de carteiras (gestão dos riscos cambial e de taxa de juro, análises e estratégias, sistemas de informação de apoio à gestão de reservas, articulação com o *backoffice*).
- Processamento de operações (*matching* de confirmações, liquidação, *settlement*, reconciliação, controlo de posições).
- Tipologia do risco e ciclo de vida das operações; medidas de sensibilidade; ratings, matrizes de transição e spread do risco de crédito; medidas estatísticas: VaR e *expected shortfall*.
- Controlo de risco.