

RISCO, CAPITAL E STRESS TESTING

ICAAP, ILAAP e Adequação de Capital

Para risco, capital e finanças: estruturar a autoavaliação de capital e liquidez, integrar cenários de esforço e preparar o diálogo com o supervisor.

DURAÇÃO	NÍVEL	FORMATO	IN-COMPANY
30h	Avançado	Online ao vivo ou presencial	Adaptado à instituição

O que resolve

No ICAAP e no ILAAP, o banco demonstra que tem capital e liquidez adequados ao seu perfil de risco, também em cenários adversos. O curso trabalha o enquadramento do Pilar 2, a identificação e quantificação dos riscos materiais, os cenários de esforço e o planeamento de capital, a adequação de liquidez e a governação e documentação do processo, com a simulação do diálogo com o supervisor. Os participantes levam um índice-modelo de relatório ICAAP, uma matriz de riscos materiais e um modelo de plano de capital sob cenários.

O que vai conseguir fazer

- Compreender a lógica e os componentes do ICAAP e do ILAAP
- Identificar riscos materiais e métodos de quantificação
- Integrar cenários de esforço no planeamento de capital e liquidez
- Definir buffers de gestão e ações de recuperação
- Estruturar a documentação e a governação do processo

Para quem

Risco, capital, finanças, planeamento estratégico e administração.

Pré-requisitos

Conhecimentos de gestão de riscos e de balanço bancário. Recomendável experiência em risco, capital ou planeamento financeiro.

Programa

- 1 Pilar 2, ICAAP e ILAAP: enquadramento
- 2 Riscos materiais e quantificação de capital interno
- 3 Cenários de esforço e planeamento de capital
- 4 ILAAP e adequação de liquidez
- 5 Governação, documentação e diálogo com o supervisor

Como aprende

Casos práticos, exercícios de quantificação e simulação do diálogo com o supervisor.

O que leva consigo

- Índice-modelo de relatório ICAAP
- Matriz de riscos materiais e métodos de quantificação
- Template de plano de capital sob cenários

Resultados esperados

O participante consegue contribuir para a preparação, a revisão e a defesa do ICAAP e do ILAAP da instituição.

Equipa formadora

Formadores com experiência prática na banca e no setor financeiro, que combinam rigor técnico com casos aplicados ao mercado angolano.

Formação in-company

Adaptamos casos, exemplos e duração à realidade de cada instituição, com dados fictícios ou anonimizados. A formação decorre online ao vivo ou presencialmente, nas instalações da instituição ou na Católica Luanda Business School.

Pedir proposta in-company

[Ver o curso e pedir proposta](#) · formacao@abf-angola.com