

RISCO, CAPITAL E STRESS TESTING

Risco de Liquidez e Planos de Contingência

Para tesouraria, ALM e risco: medir gaps e concentração de funding, testar cenários de esforço de liquidez e estruturar o plano de contingência.

DURAÇÃO	NÍVEL	FORMATO	IN-COMPANY
16h	Intermédio	Online ao vivo ou presencial	Adaptado à instituição

O que resolve

Uma crise de liquidez pode instalar-se em poucos dias, e o plano de contingência tem de estar pronto antes disso. O curso trabalha as fontes e a governação do risco de liquidez, os mapas de maturidades, gaps e métricas, a concentração de funding e os testes de esforço, e os indicadores de alerta precoce, com simulação de cenários e casos de crises de liquidez. Os participantes levam um modelo de mapa de maturidades, uma matriz de cenários de esforço, uma lista de indicadores de alerta e a estrutura de um plano de contingência.

O que vai conseguir fazer

- Compreender as fontes e a dinâmica do risco de liquidez
- Construir e interpretar mapas de maturidades e gaps
- Interpretar métricas de liquidez e de concentração de funding
- Desenhar cenários de esforço de liquidez
- Estruturar um plano de contingência de liquidez

Para quem

Tesouraria, ALM, risco, finanças e planeamento financeiro.

Pré-requisitos

Familiaridade com o balanço bancário e com funções de tesouraria, ALM ou risco.

Programa

- 1 Risco de liquidez: fontes, dinâmica e governação
- 2 Mapas de maturidades, gaps e métricas de liquidez
- 3 Concentração de funding e testes de esforço
- 4 Indicadores de alerta precoce e plano de contingência

Como aprende

Exercícios aplicados, simulação de cenários e análise de casos de crises de liquidez.

O que leva consigo

- Template de mapa de maturidades
- Matriz de cenários de esforço de liquidez
- Lista de indicadores de alerta precoce
- Estrutura de plano de contingência de liquidez

Resultados esperados

O participante consegue analisar a posição de liquidez da instituição, desenhar cenários de esforço e contribuir para o plano de contingência de liquidez.

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