



OROC | Ação de formação Nº 72/23

Assunto: **Ação de Formação Online: Gestão de Risco de Instrumentos de Capital**

Lisboa, 14 de junho de 2023

Caros Colegas,

Informamos que no próximo dia 07 de julho pelas 14h00, a OROC irá realizar uma ação de formação online sob o tema “Gestão de Risco de Instrumentos de Capital”.

Para melhor divulgação desta ação de formação, remetemos em anexo o respetivo programa.

A inscrição deverá ser efetuada no site da Ordem através do [link](#).

Com os melhores cumprimentos,

Célia Custódio

Vogal do Conselho Diretivo

Sede

Rua do Salitre, nº 51/53 | 1250-198 Lisboa
Telefone(+351) 213 536 158 | Fax(+351) 213 536 149
geral@oroc.pt

Serviços Regionais do Norte

Av. da Boavista, nº 3477/3521 2º andar | 4100-139 Porto

www.oroc.pt

GESTÃO DE RISCO DE INSTRUMENTOS DE CAPITAL

FORMAÇÃO
ONLINE

07/07/2023

Horário: 14h00 – 18h00

Formador: Pedro Barreirão

Supervisor bancário no Banco de Portugal e professor adjunto convidado no ISCAL. 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 do *Value at Risk*;
3. Métodos de *Value at Risk*;
4. Limitações do *Value at Risk*;
5. 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: 42€
Outros Profissionais: 50€