

Gestão de Capital para IFDs

Instrutor e Currículo

NAYRA TAÍS SAVORDELLI

Gerente da FBM Consulting com larga experiência em projetos voltados para o mercado financeiro, envolvendo adequação dos processos de negócios aos requerimentos do Acordo de Basileia II, definição de modelos de governança, metodologias de implementação de novos processos e sistemas, arquitetura de BI e análise de dados. Engenheira Civil pela Escola Politécnica da Universidade de São Paulo, com pós-graduação em Administração Financeira pela Instituição Vanzolini – USP e especialização em Mercado Financeiro – Derivativos pela BM&F e Banking pela FGV.

Objetivos

Entendimento sobre os principais conceitos, aspectos gerenciais e regulatórios da gestão de capital, no que se refere o ao Pilar II do acordo de Basileia.

Público-alvo

Gestores e técnicos da área de Gestão de Risco e demais áreas afins.
Pré-requisitos: conhecimentos de Basileia II.

Metodologia

O programa é conduzido por meio de aulas expositivas, nas quais são trazidos para discussão casos práticos reais e simulados, os quais estimulam a participação e o raciocínio dos participantes. A troca de experiências é incentivada e facilitada pelo instrutor, que utiliza a experiência dos participantes para tornar o curso mais próximo da realidade

Carga Horária

16h/aula

Data e Horário de Realização

09 e 10 de agosto de 2011 - 9h às 18h

Local de Realização

ABDE Brasília. SCN Qd.2 Bl. D Torre A
Salas 429/434 – Centro Empresarial Liberty Mall

Taxa de Inscrição

R\$ 870,00

Pagamento

Depósito Bancário em favor ABDE:
BANCO DO BRASIL
Ag. 1251-3 C/C:331000-0

Ficha de Pré-Inscrição

Deve ser enviada à ABDE
ATÉ 02 DE AGOSTO DE 2011

Certificados

Receberão certificados os participantes que obtiverem 80% de frequência.

Informações

Telefones: (21) 2109.6036 – 2109.6034
Fax: (21) 2109-6004
E-mail: treinamento@abde.org.br

PROGRAMA

1. INTRODUÇÃO AO ACORDO DE BASILEIA

a. Introdução

- i. A regulamentação bancária
- ii. Evolução
- iii. Principais marcos
- iv. Objetivos e sua fundamentação

b. Diferenças de abordagem entre Basileia I, Basileia II e Basileia III

- i. A regulamentação do capital: Basileia I, II e III e Banco Central do Brasil.

c. Basileia II e os três pilares

2. PILAR II DO ACORDO DE BASILEIA II

a. Introdução

- i. A gestão de capital: importância, evolução, objetivos, condições e regulamentação.
- ii. Processo de revisão e seus 4 princípios fundamentais
 - Princípios e componentes da supervisão do Pilar II (SREP)

b. Edital de Audiência Pública nº. 36

- i. Aplicação
- ii. Impactos
- iii. Implicações na organização
- iv. Papel da auditoria e validação interna

c. Processo Interno de Avaliação da Adequação de Capital (ICAAP)

- i. Estrutura, documentação, processo, cálculos com exemplos.
- ii. A estrutura do relatório passo a passo

d. Gestão de riscos corporativos

- i. Identificação de riscos;
- ii. Mensuração, materialidade e gestão de riscos.
 - Risco do negócio
 - Risco de reputação
 - Risco estratégico
 - Risco de liquidez
 - Riscos residuais
 - Risco de concentração

e. Capital regulatório, capital econômico e alocação de capital.

f. Análise de cenários e testes de estresse

- i. Requisitos econômicos financeiros, estrutura, documentação, arquitetura e rotinas
- ii. Pontos chaves na análise de sensibilidade e simulações na gestão de capital
- iii. Testes de estresse e elaboração de cenários por tipo de risco
- iv. Planejamento em condições de estresse e sua documentação
- v. Planejamento de capital: plano estratégico e pontos críticos

g. Monitoramento, controle e adequação de capital.

h. Principais desafios na implementação da estrutura de gestão de capital

i. Exemplos, roteiros e exercícios.