



Gestão de Descasamentos entre Ativos e Passivos (*Assets & Liabilities Management – ALM*) - 18h

Informações do curso

FIPECAFI

Matriz Curricular

- Introdução aos conceitos de ALM
- Gestão de riscos na tesouraria
- Mensuração e gestão de ativos e passivos financeiros (CPC 48 / IFRS 9)
- Gerenciamento de *gaps*, a utilização de *hedge* econômico e *hedge accounting*
- *Duration* e *duration* modificada
- Geração e análise de cenários
- ALM aplicado à renda fixa e à renda variável
- Gerenciamento da liquidez e reserva bancária
- Projeção da liquidez: estática e dinâmica
- Estrutura de aplicações x captações
- Precificação dos ativos de crédito
- Modelos internos para o cálculo de risco de crédito
- Modelo para cálculo de spread
- Formação de curvas de taxas de juros
- Interpolação de taxas e formação da taxa a termo
- Estrutura de *funding*
- Elementos e métodos relacionados a *Funds Transfer Pricing* (FTP)
- Formação do RAROC (*Risk Adjusted Return on Capital*)



ГІРЕСАГІ