



Gestão Estratégica de Ativos e Passivos (ALM) para Fundos de Pensão | 15h

Informações do curso

FIPECAFI

Matriz Curricular

- **Introdução ao Asset & Liability Management (ALM);**
- **Ambiente Regulatório e Normativo para Fundos de Pensão;**
- **A Governança Corporativa e sua relação com a gestão atuarial;**
- **Metodologias de Avaliação Atuarial;**
- **ALM aplicado à Renda Fixa e à Renda Variável;**
- **Estratégias de Imunização por Duration e Convexidade e suas aplicações atuariais;**
- **Construção de Curvas de Mercado, Estrutura a Termo de Taxas de Juros, Métodos de interpolação de curvas;**
- **Precificação de Ativos de Crédito;**
- **Modelos Internos para Cálculo de Risco de Crédito;**
- **Mercado de Opções Padrão: modelo de Black & Scholes;**
- **conceitos de volatilidade implícita, letras gregas e análise de preços;**
- **Modelos de Valor em Risco: Paramétrico, Histórico e Simulado;**
- **Estratégias de Cobertura e Mitigação de Riscos;**
- **Política de Investimentos alinhada ao ALM;**
- **Simulações, Testes de Estresse e Análise de Cenários;**
- **Estudo Prático: Desenvolvimento de um Plano ALM para Fundos de Pensão.**



ГІРЕСАГІ