

**Gestão de Descasamentos entre
Ativos e Passivos (Assets & Liabilities
Management – ALM) | 16 h**

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)