

No âmbito da necessidade de atualização de conhecimentos e competências prevista pela DMIF II, o Instituto de Formação Bancária lança este curso, com o intuito de permitir aos colaboradores dos intermediários financeiros a realização de formação contínua, em conformidade com o disposto no Regulamento da CMVM n.º 3/2018.

GESTÃO DE CARTEIRAS E AVALIAÇÃO DE PERFORMANCE

ATUALIZAÇÃO NO ÂMBITO DA DMIF II

e-Learning



FORMAÇÃO INTERMÉDIA

MERCADOS
FINANCEIROS

OBJETIVOS

- Compreender os conceitos e princípios fundamentais no âmbito da gestão de carteiras.
- Entender os principais modelos teóricos, de avaliação de ativos financeiros.
- Conhecer o processo de gestão de carteiras e a política de investimentos.
- Perceber a seleção de carteiras e alocação de ativos, de acordo com os diferentes perfis de risco, dos investidores.
- Aprender os indicadores de performance de carteiras, mais utilizados, na avaliação das diferentes carteiras de investimento.

e-Learning

(mensalmente
novas edições)



INFORMAÇÕES

Ana Margarida
Soromenho
a.m.soromenho@ifb.pt

+351 217 916 274

Av. da República, 35 – 8º
1050-186 Lisboa

GESTÃO DE CARTEIRAS E AVALIAÇÃO DE PERFORMANCE

ATUALIZAÇÃO NO ÂMBITO DA DMIF II

DESTINATÁRIOS

Colaboradores enquadrados no perfil Consultoria para o Investimento.

METODOLOGIA: *E-learning*

TEMPO ESTIMADO DE ESTUDO: 12 horas

PREÇO: Associado APB – 50 €

Tabela Geral – 58 €

PROGRAMA

- 1. Conceitos Básicos e Introdução à Gestão de Carteiras**
 - Rentabilidade Esperada e Rentabilidade Obtida : Conceito e cálculo
 - Ativo sem Risco
 - Prémio de Risco
 - Risco global, Risco Específico e Risco Sistemático: conceito e cálculo.
 - Carteira ou Portfólio
 - Alocação de Ativos
 - Perfis de Risco de Investidores
- 2. Introdução Gestão de Carteiras: Teoria da Carteira de Markowitz**
 - O Modelo de Markowitz
 - Correlação entre ativos
 - Diversificação: Um método de redução de risco
 - Carteira de Variância Mínima
 - Carteira Eficiente
 - *Capital Market Line*
- 3. Conceitos Básicos e Introdução aos Modelos de Avaliação de Ativos Financeiros**
 - Beta de um ativo
 - Beta de uma carteira
 - Cálculo do Risco Sistemático e Específico de um Ativo Financeiro
 - Modelo de Mercado
 - Modelo CAPM
 - Modelo APT

PROGRAMA (cont.)

- 4. Processo de Gestão de Carteiras e política de Investimentos**
 - A importância da perspectiva da Carteira
 - O Processo de Gestão de Carteiras
 - Diferentes objetivos de investimento
 - Constrangimentos na Constituição de Carteira
 - A Importância do Horizonte Temporal e da Diversificação Internacional
- 5. Seleção de Carteiras e Alocação de Ativos**
 - A Gestão de Carteiras e Critérios de Alocação de Ativos
 - Gestão de Carteiras de Ações
 - Gestão de Carteiras de Obrigações
 - A Gestão Passiva
 - A Gestão Ativa
- 6. Avaliação e Indicadores de Performance de Carteiras**
 - Índice de Treynor
 - Índice de Sharpe
 - Alfa de Jensen
 - Rácio de Informação
 - Beta
 - *Tracking Error*



FORMAÇÃO INTERMÉDIA

MERCADOS FINANCEIROS



FULL MEMBER OF

