



Gestão de Carteiras e Avaliação de Performance

FORMAÇÃO INTERMÉDIA

MERCADOS
FINANCEIROS

E-LEARNING

Formação válida para atualização no âmbito da DMIF II

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.



INFORMAÇÕES

Ana Margarida Soromenho

a.m.soromenho@ifb.pt

+351 217 916 274



DESTINATÁRIOS

Colaboradores enquadrados no perfil Consultoria para o Investimento.

METODOLOGIA: e-learning

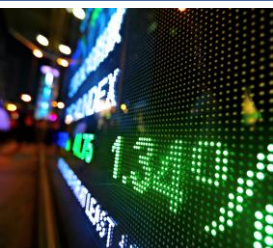
Permite o estudo em qualquer dia ou hora e possibilita o acesso através de qualquer computador ou dispositivo móvel.

DURAÇÃO: 12 horas (tempo estimado de autoestudo)

PREÇO: Associados APB: 52 € Tabela Geral: 60 €

FORMAÇÃO INTERMÉDIA

MERCADOS FINANCEIROS



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 perspetiva 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*



FULL MEMBER OF

