

## Gestão de Carteiras de Ativos Financeiros

### Objetivos Gerais

Este curso pretende dotar os participantes dos conhecimentos que permitam identificar, quantificar e gerir os principais fatores de risco associados à atividade bancária na gestão de carteiras de ativos financeiros.

### Objetivos Específicos

No final deste Curso os participantes saberão:

- 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.
- Apreender os indicadores de performance de carteiras, mais utilizados, na avaliação das diferentes carteiras de investimento.

### Destinatários

Este Curso destina-se a profissionais que necessitem desenvolver suas competências nesta área tais como colaboradores enquadrados no perfil consultoria para o Investimento com previsto conhecimentos na área da banca e bolsa de mercado.

### Pré-requisitos

Os pré-requisitos necessários para frequentar este curso são:

- Ter acesso a um computador ou um tablet com ligação à Internet e um browser (programa para navegar na web), como o Chrome, Safari, Firefox ou Internet Explorer.
- Pode aceder ao curso a partir de qualquer computador (por exemplo, em casa e no escritório), tablet ou smartphone.

### Carga Horária

12 horas

### Conteúdo Programático

**Módulo 0 – Apresentação de Plataforma e Método de Utilização**

**Módulo I – Conceitos Básicos e Introdução à Gestão de Carteiras**

- Rentabilidade Esperada e Rentabilidade Obtida: conceito e cálculo;

- Ativos em 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.

## **Módulo II – 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.

## **Módulo III – 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.

## **Módulo IV – 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.

## **Módulo V – 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.

### Módulo VI – Avaliação e Indicadores de Performance de Carteiras

- Índice de Treynor;
- Índice de Sharpe;
- Alfa de Jensen;
- Rácio de Informação;
- Beta;
- Tracking Error.

### Metodologia

Este curso tem sempre presente o formador, que irá mesmo dar a formação presencial através da plataforma.

O Formando pode intervir juntamente com o formador ou com os restantes formandos tal como faz na sala de aula.

As apresentações e exercícios serão sempre disponibilizados pelo formador no final de cada sessão de formação.

No final do curso receberá um Certificado de Formação Profissional caso frequente pelo menos 90% das aulas, realize os trabalhos e os testes propostos, participe nas discussões online e tenha avaliação final positiva.

Esta formação é certificada e reconhecida.