

# ***GESTÃO DE CARTEIRAS***

## **1. Objectivos**

Expor os agentes do mercado de capitais, nomeadamente intermediários financeiros, às principais decisões na área de Gestão de Carteiras de Títulos. O curso é essencialmente prático sendo as sessões do resultado de um misto de apresentações teóricas e resolução / discussão de casos em que os formandos podem praticar em ambiente de sala (*hands on*) os conhecimentos adquiridos ao longo do curso.

## **2. Pré-Requisitos**

O curso destina-se a formandos habilitados com um curso de licenciatura em Finanças, Gestão, Economia ou afins. Podem ainda assistir com potencial aproveitamento formandos com experiência profissional relevante na área do mercado financeiro e com conhecimentos de métodos quantitativos equivalentes ao 12º ano do ensino secundário.

## **3. Duração**

A duração da acção está prevista para 5 dias de formação com uma carga horária de 4 horas de leccionação / dia.

## **4. Datas**

O início será fixado oportunamente

## **5. Programa**

1. O Conjunto de Oportunidades de Investimento em Ambiente de Risco
2. A Construção de Carteiras Eficientes
3. A Construção da Fronteira Eficiente
4. A Estrutura de Correlação dos Activos - os modelos SIM e MIM
5. A Teoria da Utilidade na Determinação de Carteiras de Óptimas Investimento
6. Outros Critérios de Selecção de Investimentos - Modelos Comportamentais na Decisão Financeira e na Determinação de Carteiras de Óptimas Investimento
7. A Diversificação Internacional, Imobiliária e outra
8. Strategic and Tactic Asset Allocation - Experiências
9. A Avaliação do Desempenho na Gestão de Carteiras de Activos Financeiros

## **6. Materiais de Apoio à Formação**

Serão distribuídos materiais de apoio à formação que incluem slides de PowerPoint, Casos e Exercícios.