

Curso Modular de Fundos de Investimento e Gestão de Risco de Carteiras e Fundos de Investimento (*)

MÓDULO II – PRECIFICAÇÃO AVANÇADA DE TÍTULOS COM PROGRAMAÇÃO VBA

Datas: 23, 25, 30/05, 01, 06, 13, 15/06/2023 (terças e quintas)

Horário: 19h00 às 22h00 / Forma virtual (Zoom)

Carga horária: 21 horas

Este curso concede até 5,25 créditos para o PEC – Programa de Educação Continuada da APIMEC

Objetivo do Curso – Apresentar aspectos, ferramentas e metodologias importantes quanto à Gestão das Carteiras dos Fundos e à Gestão, Identificação e Mensuração dos Riscos

Público-alvo - Investidores e profissionais que atuam nas áreas de Riscos e na Administração, Gestão, Distribuição, Custódia, Controladoria e outros Serviços Qualificados da indústria de Fundos de Investimento, Private Bankers, Wealth e Asset Managers, estudantes e profissionais de outras áreas que atuem ou desejem atuar no mercado financeiro ou que desejem adquirir conhecimento amplo sobre o tema.

Pré-Requisitos - Conhecimentos de Matemática financeira; Conhecimentos de calculadora financeira e Excel.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

1. Riscos e a Gestão de Riscos
 - 1.1. Motivos e Benefícios para realizar a Gestão de Riscos de Fundos de Investimento
 - 1.1.1. Definições de Riscos
 - 1.1.2. Matriz de probabilidade x impacto
 - 1.1.3. Decisão da estratégia de Gestão do Risco
 - 1.2. Processo de Gestão de Riscos
 - 1.2.1. Metodologia
 - 1.2.2. Etapas
 - 1.2.3. A área de Risco dentro do organograma
 - 1.2.4. Estrutura e estratégias

2. Identificação e classificação dos Riscos
 - 2.1. Riscos de Negócio
 - 2.2. Riscos Estratégicos
 - 2.3. Riscos Econômicos
 - 2.4. Riscos Financeiros

3. Métodos Quantitativos
 - 3.1. Mensuração dos Retornos – modelagens aplicadas ao mercado financeiro
 - 3.2. Mensuração das Volatilidades – modelagens aplicadas ao mercado financeiro
 - 3.3. Mensuração das Correlações – modelagens aplicadas ao mercado financeiro

4. Instrumentos de Medidas de Risco e Imunização de carteiras de Renda Fixa
 - 4.1. Duration e Duration Modificada
 - 4.2. Imunização de Carteiras pela Duration (Delta Hedge)
 - 4.3. Utilização de Duration para ALM

5. Value at Risk (VaR)
 - 5.1. Origens e motivações para o uso do VaR
 - 5.2. VaR (Value at Risk)
 - 5.3. VaR de simulação paramétrica
 - 5.4. VaR de Simulação Histórica
 - 5.5. VaR de Simulação de Monte Carlo

6. Análise da escolha dos ativos
 - 6.1. Razão de Eficiência
 - 6.2. Índice de Sharpe
 - 6.3. Índice de Treynor
 - 6.4. Índice de Sortino

7. Análise de Fundos Passivos
 - 7.1. Pilares da gestão passiva
 - 7.2. Tracking Error
 - 7.3. Erro Quadrático Médio - EQM

INVESTIMENTO:	INSTRUTOR
<p>- Associados da APIMEC Brasil: R\$ 1.200,00</p> <p>- Analistas Credenciados, Profissionais Certificados CNPI e RPPS e Associados dos Apoiadores**:</p> <p style="padding-left: 150px;">R\$ 1.500,00</p> <p>- Outros interessados: R\$ 1.800,00</p> <p style="text-align: center;">INSCRIÇÕES ATÉ 16/05/2023</p> <p style="text-align: center;">Clique aqui</p> <p style="text-align: center;">VAGAS LIMITADAS! Faça sua inscrição!</p> <p style="text-align: center;">Curso sujeito a formação de turma</p>	<p>PROFESSOR SERGIO SHMAYEV</p> <p>Experiência profissional de mais 30 anos na área de educação e mais de 22 anos em grandes corporações, atualmente é professor e consultor financeiro e empresarial. Professor nas instituições: Instituto Educacional da B3, ANBIMA, FIPECAFI, CNF, APIMEC, Ibmecc, Saint Paul e BSG DuoPrata Treinamentos. É membro da PRMIA (Professional Risk Managers' International Association), Membro do FPA (Financial Planning Association). Certificado CPA10, CPA20, PQO/B3, PQO/B3 na área de Operações e Riscos</p>

** ENTIDADES APOIADORAS: ABAAI / ABRASCA / ANCORD / CRA-SP / IBRI

Coordenação: Francisco D'Orto Neto
Diretor de Educação e Certificação – APIMEC Brasil