

Curso Modular de Renda Fixa (*)

MÓDULO IV – PRECIFICAÇÃO AVANÇADA DE TÍTULOS COM PROGRAMAÇÃO VBA

Datas: 12, 17, 19, 24, 26, 31/07, 02, 07, 09 e 14/08/2023 (segundas e quartas)
Horário: 19h00 às 22h00 / Forma virtual (Zoom)
Carga horária: 30 horas

**Este curso concede até 7,50 créditos
para o PEC – Programa de Educação Continuada da APIMEC**

Objetivo do Curso – Aplicação da programação VBA Excel com foco no mercado financeiro, com a criação e utilização de funções na precificação de títulos e carteiras de renda de renda fixa. Cálculos avançados de precificação utilizando curvas de juros para carteiras e títulos de renda fixa e métodos de interpolação.

Público-alvo - Investidores e profissionais que atuam no mercado financeiro, estudantes e profissionais de outras áreas que desejam atuar no mercado financeiro ou que desejem aprofundar seus conhecimentos do mercado.

Pré-Requisitos – Ter feito o Módulo 3 – Programação VBA e Precificação de Títulos com Programação.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

1. Mercado futuro de Taxas de Juros

- 1.1. Mercados futuros de taxas de juros (características e funcionamento)
- 1.2. Contrato Futuro de DI
- 1.3. Contrato futuro de cupom de IPCA

2. Estrutura a termo da taxa de juro e técnicas de interpolação com criação de funções de interpolação VBA

- 2.1. Taxa Spot, Forward
- 2.2. ETTJ
- 2.3. Interpolação aritmética
- 2.4. Interpolação Geométrica (flat-forward)
- 2.5. Curva PAR-Yield
- 2.6. ETTJ de N-S-S

3. Criando funções de precificação utilizando as ETTJs e métodos de determinação das TIRs correspondentes

- 3.1. Criação de funções de precificação de títulos privados utilizando programação VBA e curvas ETTJ
 - 3.1.1. Função VBA para precificação de títulos zero cupom com ETTJs
 - 3.1.2. Função VBA para precificação de títulos com cupom com ETTJs
 - 3.1.3. Função VBA para precificação de carteiras de títulos com fluxos variáveis (ex. carteiras de FIDCs) com ETTJs

- 3.2. Criação de funções de precificação de títulos públicos utilizando programação VBA e curvas ETTJ
 - 3.2.1. Funções VBA para precificação de LTN e NTN-F com ETTJs
 - 3.2.2. Funções VBA para precificação de NTN-B com e sem cupom com ETTJs
 - 3.2.3. Função VBA para precificação de LFTs com ETTJs
- 3.3. Criação de funções de precificação de títulos privados utilizando programação VBA e curvas ETTJ
 - 3.3.1. Função VBA para precificação de debentures com ETTJs
 - 3.3.2. Função VBA para precificação de CDBs pós fixados ETTJs

| INVESTIMENTO: | INSTRUTOR |
|---|---|
| <p>- Associados da APIMEC Brasil: R\$ 2.000,00</p> <p>- Analistas Credenciados, Profissionais Certificados CNPI e RPPS e Associados dos Apoiadores**: R\$ 2.500,00</p> <p>- Outros interessados: R\$ 3.000,00</p> <p style="text-align: center;">INSCRIÇÕES ATÉ 06/07/2023</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

(*)O próximo será Módulo 5 – Gestão de Carteiras