



Mercado Financeiro e Gestão de Portfólios

Programa do Curso

Vítor Wilher, Cientista-Chefe da Análise Macro

Sumário

1	A sua porta de entrada para a análise de dados no mercado financeiro	2
2	Organização do Curso	2
3	Público-alvo	2
4	Seções do Curso	2
5	Laboratórios	3
6	Material do Curso	3
7	Como você fará o curso?	3

1 A sua porta de entrada para a análise de dados no mercado financeiro

O mercado financeiro sempre foi intensivo no uso de bases de dados, o que exige do profissional do setor conhecimentos abrangentes sobre diversas ferramentas de análise de dados.

Pensando nisso, resolvemos reestruturar nosso tradicional curso de Gestão de Portfólios. Renomeado como Mercado Financeiro e Gestão de Portfólios, o curso agora possibilita tanto uma introdução ao mercado financeiro, quanto o conhecimento das principais técnicas de gestão de portfólio. Além disso, provê o aluno com o uso intensivo do R, uma das linguagens de programação mais utilizadas no mundo da ciência de dados.

2 Organização do Curso

Ao se inscrever no Curso de Mercado Financeiro e Gestão de Portfólios, o aluno terá acesso a dois blocos de conteúdo: (1) Curso de Mercado Financeiro e Gestão de Portfólios; (2) Laboratórios.

Nas 15 seções do Curso de Mercado Financeiro e Gestão de Portfólios, o aluno irá aprender tudo sobre os principais produtos e instituições financeiras, risco e retorno de ativos, bem como sobre como construir e administrar o seu portfólio com o R. Por fim, ficará disponível um módulo Laboratórios com a disponibilização de códigos super práticos para a construção de shiny apps.

3 Público-alvo

O Curso se destina basicamente a profissionais do mercado financeiro em busca de novas ferramentas analíticas, professores de graduação e pós-graduação envolvidos no ensino e pesquisa de finanças, bem como estudantes de graduação e pós-graduação em busca de diferenciais competitivos para ingressar no mercado.

4 Seções do Curso

- Seção 01 - Apresentação do Curso
- Seção 02 - Fundamentos Estatísticos
- Seção 03 - Coleta de dados financeiros com o R
- Seção 04 - Mercados Financeiros
- Seção 05 - Juros
- Seção 06 - Riscos financeiros
- Seção 07 - Produtos financeiros
- Seção 08 - Mercado de Renda Fixa
- Seção 09 - Mercado de Ações
- Seção 10 - Risco vs. Retorno
- Seção 11 - Seleção de Carteira e Teoria de Markowitz
- Seção 12 - Índice de Sharp
- Seção 13 - Capital Asset Pricing Model (CAPM)
- Seção 14 - Modelo Fama-French
- Seção 15 - Derivativos

5 Laboratórios

- Laboratório 01 - Transformando preços em retornos
- Laboratório 02 - Construindo um Shiny App para Retornos de Portfólios
- Laboratório 03 - Construindo um Shiny App para Desvio-Padrão
- Laboratório 04 - Construindo um Shiny App para assimetria e curtose de retornos
- Laboratório 05 - Shiny App para índice sharpe
- Laboratório 06 - Shiny App para CAPM Beta
- Laboratório 07 - Construindo um Shiny App para o modelo Fama-French
- Laboratório 08 - Contribuição do ativo para o desvio padrão do portfólio
- Laboratório 09 - Simulação de Monte Carlo

6 Material do Curso

- Vídeos Didáticos: Cada seção será acompanhada de um vídeo gravado que conduzirá o aluno em todos os passos.
- Apostilas e Scripts disponíveis: Cada seção conta com apostila em pdf e script em RMark-down, de modo que o aluno possa reproduzir tudo o que é desenvolvido na aula.
- Laboratórios: De forma a complementar o ensino, disponibilizamos laboratórios práticos para que o aluno possa construir suas próprias aplicações.

7 Como você fará o curso?

Nosso Curso é 100% adaptável à sua rotina de trabalho ou estudo. Você escolhe o melhor horário para assistir aos vídeos gravados e aprofundar o tema da videoaula replicando o exercício realizado pelo professor. Todos os códigos utilizados são disponibilizados para que o aluno possa aprender de forma autônoma. De forma a dar maior atenção aos alunos, o Curso será ofertada em turma com limitação no número de alunos.