

## 1. Caracterização da Unidade Curricular

### 1.1. Designação da Unidade Curricular

#### 1.1.1. Designação

---

Avaliação de Obrigações e Produtos Estruturados

Curso(s):

Mestrado em Análise Financeira

#### 1.1.2. *Designation*

---

Bond Valuation and Structured Products

Course(s):

Master in Financial Analysis

### 1.2. Sigla da área científica em que se insere

#### 1.2.1. Sigla da área científica

---

FE

#### 1.2.2. *Scientific area's acronym*

---

FE

### 1.3. Duração da Unidade Curricular

#### 1.3.1. Duração

---

Semestral

#### 1.3.2. *Duration*

---

Semestral

### 1.4. Total de horas de trabalho

#### 1.4.1. Horas de trabalho

---

Horas de Trabalho: 0108:00

#### 1.4.2. *Working hours*

---

Working hours: 0108:00

**1.5. Total de horas de contacto**

**1.5.1. Horas de contacto**

---

(T) Teóricas:	0000:00	(TC) Trabalho de Campo:	0000:00
(TP) Teórico-Práticas:	0022:30	(OT) Orientação Tutorial:	0005:00
(P) Práticas:	0000:00	(E) Estágio:	0000:00
(PL) Práticas Laboratoriais:	0000:00	(O) Outras:	0005:00
(S) Seminário:	0000:00		
Horas Contacto:	0032:30		

**1.5.2. Contact hours**

---

(T) Theoretical:	0000:00	(TC) Field Work:	0000:00
(TP) Theoretical-practical:	0022:30	(OT) Tutorial Guidance:	0005:00
(P) Practical:	0000:00	(E) Internship:	0000:00
(PL) Laboratory practices:	0000:00	(O) Other:	0005:00
(S) Seminar:	0000:00		
Contact Hours:	0032:30		

**1.6. ECTS**

4

**1.7. Observações**

**1.7.1. Observações**

Sem observações

**1.7.2. Comments**

No additional comments

**2. Docente responsável e respetiva carga letiva na Unidade Curricular**

**2.1. Docente responsável e carga letiva (preencher o nome completo)**

**ANTÓNIO GIL MARGALHO NOGUEIRA**

TPMNAF21 (1.5 horas semanais; 22.5 horas semestrais)

**2.2. Responsible academic staff member and lecturing load (fill in the full name)**

**ANTÓNIO GIL MARGALHO NOGUEIRA**

TPMNAF21 (1.5 week hours; 22.5 semester hours)

### 3. Outros docentes e respetivas cargas letivas na Unidade Curricular

#### 3.1. Outros docentes e respetivas carga letivas

---

#### 3.2. *Other academic staff and lecturing load*

---

### 4. Objetivos de aprendizagem (conhecimentos, aptidões e competências a desenvolver pelos estudantes)

#### 4.1. Objetivos de aprendizagem

---

Introduzir modelos e técnicas de avaliação de obrigações e de produtos estruturados.

#### 4.2. *Learning outcomes of the curricular unit*

---

Introduce models and evaluation techniques for bonds and structured products.

### 5. Conteúdos programáticos

#### 5.1. Conteúdos

---

Mercados de obrigações / taxas de juro

Avaliação de obrigações

Análise de taxas de juro

Risco de crédito

Produtos estruturados

Tópicos avançados

## 5.2. *Syllabus*

---

Bond / interest rate markets

Bond evaluation

Interest rate analysis

Credit risk

Structured products

Advanced topics

## 6. Demonstração da coerência dos conteúdos programáticos com os objetivos da Unidade Curricular

### 6.1. Demonstração da coerência dos conteúdos programáticos

---

Os alunos deverão conhecer o funcionamento dos mercados de obrigações e de produtos estruturados, bem como estar preparados para avaliar estes ativos.

### 6.2. *Demonstration of the syllabus coherence with the curricular unit's objectives*

---

Students should know how the market for bonds and structured products works, and should be able to evaluate these assets.

## 7. Metodologias de ensino (avaliação incluída)

### 7.1. Metodologias de ensino (avaliação incluída)

---

Teste(60%) + projeto (40%), ou exame final (100%).

### 7.2. *Teaching methodologies (including evaluation)*

---

Test(60%) + project(40%) or final exam (100%).

## 8. Demonstração da coerência das metodologias de ensino com os objetivos de aprendizagem da Unidade Curricular

### 8.1. Demonstração da coerência das metodologias

---

A realização de testes e projetos tem como objetivo aferir se os alunos conseguiram obter com sucesso os conhecimentos transmitidos na unidade curricular.

**8.2. *Demonstration of the coherence between the teaching methodologies and the learning outcomes***

---

Tests and projects seek to assess whether students understood the contents of the course.

**9. Bibliografia de consulta/existência obrigatória**

---

Materiais de apoio.

Bodie, Kane e Marcus (2013). Investments 10<sup>th</sup> Edition, McGraw-Hill.

Fabozzi e Mann (2012). The Handbook of Fixed Income Securities, 8th Edition McGraw-Hill.