

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 MANUEL GONÇALVES DA SILVA SARAGGA SEABRA
TPMNAF21 (1.5 horas semanais; 22.5 horas semestrais)

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

ANTÓNIO MANUEL GONÇALVES DA SILVA SARAGGA SEABRA
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

Conhecimentos:

Mercados de Taxa de Juro e de Crédito

Relacionamento entre Política Monetária e Estrutura Temporal Taxas de Juro

Características de Emissões de Obrigações

O Processo de Rating

Tipologia de Produtos Estruturados

Aptidões e Competências:

Valorização de Obrigações e Produtos Estruturados

Gestão de Risco de Taxa de Juro e de Crédito

Modelizar Processos Estocásticos de Evolução de Taxas de Juro

Analisar interdependência entre Mercados de Obrigações e Mercado Acionista

4.2. *Learning outcomes of the curricular unit*

Knowledge:

Interest Rate and Credit Markets

Monetary Policy and the Yield Curve

The Rating Process

Structured Products Zoo

Skills:

Bond & Structured Products Pricing

Management of Interest and Credit Risk

To Model Stochastic Processes for Interest Rate Dynamics

Structural Models and the Theoretical Dependency Between Bond and Equity Markets

5. Conteúdos programáticos

5.1. Conteúdos

Elementos de Cálculo Financeiro
Mercado Monetário
O Design de Emissões de Obrigações
Gestão do Risco de Taxa de Juro
Estrutura Temporal de Taxas de Juro
Valorização de Obrigações
Análise e Gestão de Risco de Crédito
Produtos Estruturados

5.2. Syllabus

Financial Calculus
Money Market
The Design of Bond Issues
Risk Management of Interest Rate Products
Yield Curve
Bond Pricing
Management and Valuation of Credit Risk
Structured Products

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

6.1. Demonstração da coerência dos conteúdos programáticos

O programa permitirá um conhecimento aprofundado de métodos de avaliação de obrigações e produtos estruturados em simultâneo com a realização de casos práticos baseados experiências reais.

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

The program will allow an in-depth knowledge of methods for bond and structured products val

7. Metodologias de ensino (avaliação incluída)

7.1. Metodologias de ensino (avaliação incluída)

Aulas teóricas acompanhadas de exercícios ilustrativos

Estudo de casos

Trabalho individual relativo à análise e valorização de uma emissão de obrigações

Teste com consulta

7.2. *Teaching methodologies (including evaluation)*

Case studies

Students must write a short paper analysing and pricing one bond issue

Quiz tests

One open-book test

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

8.1. Demonstração da coerência das metodologias

O trabalho individual irá permitir pôr em prática os conhecimentos adquiridos através da análise de uma empresa e emissão reais

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

By writing a short paper about the analysis and pricing of a bond issue, student will be able to practice the knowledge and skills acquired

9. Bibliografia de consulta/existência obrigatória

Textos de Apoio

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

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