

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 Degree in Financial Analysis

1.2. Sigla da área científica em que se insere

1.2.1. Sigla da área científica

FN

1.2.2. Scientific area's acronym

FN

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:	0000:00
(P) Práticas:	0000:00	(E) Estágio:	0000:00
(PL) Práticas Laboratoriais:	0000:00	(O) Outras:	0000:00
(S) Seminário:	0000:00		
Horas Contacto:	0022:30		

1.5.2. Contact hours

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

1.5.3. % Horas de contacto à distância

Sem horas de contacto à distância

1.5.4. % Remote contact hours

No remote hours

1.6. ECTS

4

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
TPMAF21 (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
TPMAF21 (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

ANTÓNIO GIL MARGALHO NOGUEIRA
TPMAF21 (1.5 horas semanais; 22.5 horas semestrais)

3.2. *Other academic staff and lecturing load*

ANTÓNIO GIL MARGALHO NOGUEIRA

TPMAF21 (1.5 week hours; 22.5 semester hours)

4. Objetivos de aprendizagem

4.1. Objetivos de aprendizagem e a sua compatibilidade com o método de ensino (conhecimentos, aptidões e competências a desenvolver pelos estudantes)

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

4.2. *Learning objectives and their compatibility with the teaching method (knowledge, skills and competencies to be developed by students)*

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

6.1. Demonstração da coerência dos conteúdos programáticos com os objetivos de aprendizagem da unidade curricular

Os conteúdos do programa fornecem os fundamentos necessários à avaliação de obrigações e de produtos estruturados. Assim, a sua inclusão no programa é importante para alcançar os objetivos de aprendizagem.

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

The contents of the syllabus provide the necessary foundations for evaluating bonds and structured products. Therefore, their inclusion is important for achieving the learning objectives.

7. Metodologias de ensino**7.1. Metodologias de ensino e de aprendizagem específicas da unidade curricular articuladas com o modelo pedagógico**

Aulas teórico-práticas e resolução de exercícios.

7.2. *Teaching and learning methodologies specific to the curricular unit articulated with the pedagogical model*

Theoretical-practical classes and exercise solving.

8. Avaliação**8.1 Avaliação**

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

8.2 *Evaluation*

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

9. Demonstração da coerência das metodologias**9.1. Demonstração da coerência das metodologias de ensino com os objetivos de aprendizagem da Unidade Curricular**

A aplicação das metodologias de ensino da disciplina verifica-se na utilização de modelos e técnicas de avaliação de obrigações e produtos estruturados, bem como na exposição dos alunos a situações que requerem a utilização de conhecimentos relacionados.

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

The application of the teaching methodologies of the course is reflected in the use of models and techniques to evaluate bonds and structured products, as well as in exposing students to situations that require them to apply related knowledge.

10. Bibliografia de consulta/existência obrigatória

Materiais indicados em aula.

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

Fabozzi, Frank e Steven Mann. The Handbook of Fixed Income Securities. McGraw Hill, Eighth Edition, 2011

Fabozzi, Frank J., e Francesco A. Fabozzi. Bond markets, analysis, and strategies. MIT Press, tenth edition, 2021

Hull, John. Options, futures, and other derivatives. Pearson, ninth edition, 2014

11. Observações

11.1. Observações

11.2. *Observations*
