

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

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:	0022:50	(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:	0032:50		

1.5.2. Contact hours

(T) Theoretical:	0000:00	(TC) Field Work:	0000:00
(TP) Theoretical-practical:	0022:50	(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:	0032:50		

1.6. ECTS

4

1.7. Observações

1.7.1. Observações

Sem observações.

1.7.2. Comments

Sem observações

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

TPMAFN21 (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

TPMAFN21 (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

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

Acquisition of knowledge about bonds and structured products with practical application.

7. Metodologias de ensino (avaliação incluída)**7.1. Metodologias de ensino (avaliação incluída)**

Aulas teórico-práticas e resolução de exercícios.

7.2. *Teaching methodologies (including evaluation)*

Aulas teórico-práticas e resolução de exercícios.

8. Demonstração da coerência das metodologias de ensino com os objetivos de aprendizagem da Unidade Curricular**8.1. Demonstração da coerência das metodologias**

Teste(70%) + projeto (30%), ou exame final (100%).

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

Test (70%) and project (30%), or a final exam (100%).

9. 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