

Méthodes actuarielles

ECTS:3

Volume horaire: 21

Description du contenu de l'enseignement :

- 1. Instruments et marchés (marchés monétaires, marchés obligataires)
- 2. Mesure et couverture du risque de taux (duration, convexité, ACP)
- 3. Reconstitution de la structure par terme des taux (modèles à splines, modèles paramétriques)
- 4. Théories de la structure par terme des taux (anticipations pures, prime de risque pure, segmentation, anticipations biaisées)
- 5. Gestion passive (tracking error, échantillonnage stratifié)
- 6. Gestion active (roll-down, barbell, bullet, butterfly)
- 7. Produits dérivés de taux (futures & swaps)

Compétence à acquérir :

Fournir une explication détaillée de la structure par terme des taux et apporter un éclairage sur les différentes stratégies de gestion et leur mise en œuvre.

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16 - 01/07/2025