

Marché de Taux

ECTS:3

Description du contenu de l'enseignement :

Marchés de taux d'intérêts, marchés des dérivés de taux

- Maitrise des principes sous-jacents à l'organisation et au fonctionnement des marchés de taux
- Développer des connaissances théoriques sur l'estimation des courbes de taux et sur l'évaluation la couverture des risques sous-jacents
- Développer des connaissances sur l'analyse et l'évaluation des obligations et des dérivés de taux
- Initiation aux problématiques de finance durable et actifs ESG

Compétence à acquérir :

- Analyse du risque et évaluation des obligations
- Stratégies de couverture du risque de taux et d'inflation avec les instruments dérivés
- Principes de fonctionnement des marchés de taux

Mode de contrôle des connaissances :

examen sur table rendu "Trade idea"

Bibliographie, lectures recommandées :

Fixed-Income Securities: Valuation, Risk Management, and Portfolio Strategies, Lionel Martellini, Philippe Priaulet Fixed Income Analysis, CFA institute, Barbara S. Petitt (Author), Jerald E. Pinto, Wendy L. Pirie, Bob Interest Rate Risk Modeling, Wiley, Sanjay K. Nawalkha, Gloria M. Soto, Natalia A. Beliaeva Fixed Income Mathematics, Analytical & Statistical Techniques, Frank J. Fabozzi

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16 - 04/11/2025