

## Marché de Taux

ECTS : 3

### Description du contenu de l'enseignement :

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

- Maîtrise 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. Pettit (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