

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. 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

**Document susceptible de mise à jour - 18/02/2026**

**Université Paris Dauphine - PSL** - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16