Gestion avancée de produits de taux.

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

Le cours se propose d'acquérir les connaissances et compétences pour la gestion de portefeuilles obligataires: découverte du panorama de la typologie des obligations et introduction au calcul obligataire, apprentissage de la couverture du risque de taux d'intérêt pour des produits à flux déterministes, compréhension de la structure par terme des taux d'intérêt, connaissance de la gestion obligataire passive et active, mesure de la performance et du risque des stratégies obligataires en fonction d'anticipations sur les mouvements de la courbe des taux, étude des produits dérivés de taux.
Intitulé des grands chapitres : 1. Panorama des marchés obligataires et de la typologie des obligations . 2. Mesure et couverture du risque de taux. 3. Structure par terme des taux. 4.Formes et théories de la structure par terme des taux 5. Gestion passive 6. Gestion active 7. Produits dérivés de taux.

Compétence à acquérir :

Gestion de portefeuilles.