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

Document susceptible de mise à jour - 05/11/2026
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16