

Finance Quantitative des Taux : Comprendre, Modéliser et Valoriser les Produits Obligataires et Dérivés

Lien : https://maroc-performance.com/formation/finance-quantitative-des-taux-comprendre-modeliser-et-valoriser-les-produits-obligataires-et-derives

DURÉE	RÉFÉRENCE	CATÉGORIE
5 jours (35h)	**FA81**	**Finance de Marché**

Maroc Performance

OBJECTIFS DE LA FORMATION

À l'issue de cette formation, vous serez capable de :

- Comprendre les bases des mathématiques financières appliquées aux taux
- Maîtriser les méthodes d’actualisation et de capitalisation
- Évaluer les obligations et produits de taux
- Analyser la structure des taux d’intérêt
- Mesurer le risque de taux
- Appliquer les modèles financiers aux produits de marché
- Comprendre les produits dérivés de taux
- Développer des stratégies financières sur les marchés
- Résoudre des problématiques financières concrètes
- Renforcer les compétences en finance quantitative

👥 POUR QUI ?

- ✔ Analystes financiers et quantitatifs
- ✔ Traders et opérateurs de marché
- ✔ Gestionnaires de portefeuille obligataire
- ✔ Ingénieurs financiers et actuaires
- ✔ Banquiers et conseillers en investissement
- ✔ Risk managers et contrôleurs financiers
- ✔ Professionnels des marchés obligataires
- ✔ Toute personne souhaitant maîtriser les mathématiques financières des produits de taux

Maroc Performance



Programme détaillé

1 / FONDAMENTAUX DES MATHÉMATIQUES FINANCIÈRES

- Compréhension des principes de base de la valeur de l’argent dans le temps
- Notions d’intérêt simple et composé
- Application des bases mathématiques aux instruments financiers

2 / ACTUALISATION ET CAPITALISATION

- Calcul de la valeur actuelle et future des flux financiers
- Utilisation des taux d’actualisation
- Analyse de l’impact du temps sur la valeur financière

3 / STRUCTURE DES TAUX D’INTÉRÊT

- Compréhension des différents types de taux (nominal, actuariel, spot, forward)
- Construction des courbes de taux
- Analyse des mécanismes de formation des taux

4 / OBLIGATIONS ET PRODUITS DE TAUX

- Évaluation des obligations simples et complexes
- Calcul du prix des obligations
- Analyse des coupons et de la maturité

5 / VALORISATION DES FLUX FINANCIERS

Maroc Performance

- Actualisation des flux de trésorerie futurs
- Calcul de la valeur des produits financiers de taux
- Analyse des cash-flows actualisés

6 / MESURE DU RISQUE DE TAUX

- Introduction à la duration et à la convexité
- Sensibilité des prix aux variations de taux
- Analyse des scénarios de marché

7 / ARBITRAGE ET STRATÉGIES DE MARCHÉ

- Identification des opportunités d’arbitrage
- Mise en place de stratégies sur les marchés de taux
- Optimisation des rendements financiers

8 / PRODUITS DÉRIVÉS DE TAUX

- Introduction aux swaps et futures de taux
- Compréhension des mécanismes de couverture
- Valorisation des instruments dérivés

9 / MODÉLISATION FINANCIÈRE DES TAUX

- Construction de modèles mathématiques des taux
- Simulation de scénarios économiques
- Prévision des évolutions de marché

10 / CAS PRATIQUES ET APPLICATIONS FINANCIÈRES

- Résolution d’exercices sur les produits de taux
- Études de cas réels de marché
- Application des concepts en situation professionnelle

Maroc Performance

Approche pédagogique

- Support Ecrit et Projection
- Exposés Interactifs, Podcasts et Vidéos
- Brainstorming et Jeux de Rôle
- Mises en Situation pour faciliter l'assimilation
- Cas Pratiques et Labs inclus pour leur impact opérationnel
- Test de Validation des Acquis des Connaissances

Prochaines dates programmées

25 au 29 Jan. 2027	Présentiel - Casablanca
22 au 26 Mars 2027	Présentiel - Casablanca
17 au 21 Mai 2027	Présentiel - Casablanca
12 au 16 Juil. 2027	Présentiel - Casablanca
06 au 10 Sep. 2027	Présentiel - Casablanca

Autres dates possibles sur demande. Contactez-nous pour organiser une session intra-entreprise.

Réservation & Renseignements

Téléphone : +212 522 247 210
Email : contact@maroc-performance.com
Web : https//www.maroc-performance.com

Maroc Performance — Tous droits réservés