

Finance Quantitative : Maîtriser le Pricing et la Modélisation des Produits Structurés de Taux

Lien : https://maroc-performance.com/formation/finance-quantitative-maitriser-le-pricing-et-la-modelisation-des-produits-structures-de-taux

DURÉE
5 jours (35h)

RÉFÉRENCE
FA80

CATÉGORIE
Finance de Marché

Maroc Performance

🎯 OBJECTIFS DE LA FORMATION

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

- ✔ Comprendre les mécanismes des produits structurés de taux
- ✔ Maîtriser les bases des taux d’intérêt et de leur structuration
- ✔ Savoir modéliser les courbes de taux
- ✔ Appliquer les méthodes de pricing des produits financiers complexes
- ✔ Utiliser les outils de simulation financière
- ✔ Évaluer et gérer le risque de taux
- ✔ Comprendre les instruments dérivés de taux
- ✔ Calibrer et valider des modèles quantitatifs
- ✔ Analyser des produits financiers complexes
- ✔ Développer des compétences en finance quantitative
- ✔ Interpréter les données de marché obligataire
- ✔ Appliquer les normes réglementaires financières

👥 POUR QUI ?

- ✔ Traders et structurers
- ✔ Analystes financiers
- ✔ Ingénieurs financiers quantitatifs
- ✔ Gestionnaires de portefeuille
- ✔ Banquiers d’investissement
- ✔ Risk managers
- ✔ Actuaires financiers
- ✔ Chercheurs en économie financière
- ✔ Responsables de trésorerie
- ✔ Toute personne évoluant en finance de marché

Maroc Performance



Programme détaillé

1 / Introduction au pricing des produits financiers structurés

- Définition des produits structurés
- Rôle du pricing dans la finance de marché
- Typologie des produits structurés de taux

2 / Fondamentaux des taux d’intérêt

- Mécanismes de fixation des taux
- Courbes de taux et structures de marché
- Notions de base en finance quantitative

3 / Mathématiques financières appliquées

- Actualisation et capitalisation
- Calcul des flux financiers
- Mesure du rendement et du risque

4 / Modélisation des taux d’intérêt

- Modèles stochastiques des taux
- Courbes forward et spot
- Calibration des modèles financiers

5 / Pricing des produits structurés de taux

Maroc Performance

- Méthodes de valorisation
- Simulation Monte Carlo
- Arbres binomiaux et trinominaux

6 / Gestion du risque de taux

- Sensibilités (DV01, duration, convexité)
- Couverture des risques de taux
- Stress testing et scénarios

7 / Instruments dérivés de taux

- Swaps de taux d’intérêt
- Options sur taux (caps, floors, swaptions)
- Produits hybrides structurés

8 / Calibration et validation des modèles

- Ajustement aux données de marché
- Backtesting des modèles
- Validation des hypothèses financières

9 / Mise en pratique et cas réels

- Pricing de produits structurés complexes
- Analyse de portefeuilles de taux
- Études de cas en banque d’investissement

10 / Environnement réglementaire et marché

- Cadre réglementaire financier
- Normes prudentielles (Bâle)
- Organisation des marchés financiers

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

07 au 11 Déc. 2026	Présentiel - Casablanca
15 au 19 Fév. 2027	Présentiel - Casablanca
12 au 16 Avr. 2027	Présentiel - Casablanca
07 au 11 Juin 2027	Présentiel - Casablanca
02 au 06 Août 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

Maroc Performance