



# SYLLABUS



Cours : Techniques Bancaires

Ects :

Niveau d'étude : Master 1 MBFA « Parcours ARB »

Semestre : 2

CM : 20 heures

Enseignant : Jules SADEFO KAMDEM

TD : 0 heures

E-mail : jules.sadefo-kamdem@umontpellier.fr

## Présentation et objectifs du cours

**Ce cours a pour objectif de compléter les connaissances des étudiants en mathématiques financière, les techniques quantitatives importantes pour l'analyse pratique des risques bancaires, mais aussi de faire des illustrations avec des études de cas.**

## Pré-requis (Facultatif)

-Éléments de mathématiques financières

## Contenu

- Chapitre 1 : La banque et l'environnement bancaire
- Chapitre 2 : L'intérêt
- Chapitre 3 : La courbe des taux d'intérêt
- Chapitre 4 : Duration et immunisation de portefeuille obligataire
- Chapitre 5 : Convexité et Gestion Actif-Passif
- Chapitre 6 : Pratiques des risques bancaires

## Evaluation

Modalité de contrôle des connaissances : **Écrit**

## Éléments bibliographiques (Facultatif)

- Pierre Devolder et Mathide Fox (2018) : **Mathématiques Financières**, Pearson