

Index

- adjudication, 36, 38, 55
- AFT, 36, 55
- Agence France Trésor, 35, 36
- agences d'évaluation, 77
- agences de notation, 83
- agences de rating, 81
- benchmark, 16, 19, 41, 79
- Bon à Moyen Terme, 40
- Bon à Moyen Terme Négociables, 39
- bons du Trésor, 21
- BTAN, 54, 56
- BTF, 33, 36
- bullet, 46
- cap, 107
- certificats de dépôt, 18, 20, 39
- collar, 112, 114
- contrat obligataire, 49
- convexité, 57, 100, 101
- cotation, 63
- coupon, 52, 58, 59, 69, 94
- coupon couru, 64
- courbe des taux d'intérêt, 22
- démembrement, 55
- dettes junior, 53
- dettes senior, 53
- duration, 96, 97, 98, 100, 101
- duration d'un portefeuille, 103
- EONIA, 16
- Euribor, 16, 26, 51, 113, 120
- floor, 111
- fonds d'amortissement, 53
- Forward Rate Agreement, 27
- intérêts post-comptés, 21
- intérêts précomptés, 21
- junk bonds, 80
- juste valeur, 122
- marché interbancaire, 26
- marché secondaire, 22
- marchés à terme, 27, 29
- marge actuarielle, 66
- maturité, 44, 68
- notation, 78, 79
- OAT indexées, 59
- OAT Obligations Assimilables du Trésor, 55
- obligation à bon de souscription d'action (OBSA), 61
- obligation à coupon 0, 62
- obligation à coupon zéro, 69
- obligation à fenêtre, 62
- obligation à taux flottant, 102
- obligation à taux flottant inversé OTFI, 58
- obligation à zéro coupon, 100
- obligation convertible, OCEANE, 61
- obligations à coupon, 99
- obligations à coupon zéro, 55, 60, 84
- option de remboursement anticipé, 47
- piéd du coupon, 63
- point de base, 20
- politique monétaire, 11
- préférence pour la liquidité, 72
- prime, 108, 110
- prime d'émission, 48, 49
- prime de remboursement, 48
- prime de risque, 72
- remboursement, 46
- remboursement du capital, 95
- sensibilité, 57, 94, 96, 98, 101
- Spécialiste en Valeurs du Trésor (SVT), 35
- spread, 51, 77, 79, 83, 117
- Standard & Poor's, 41
- structure, 25
- structure des taux, 84
- structure des taux d'intérêt, 67, 69, 35
- swap, 16, 115, 122
- syndicat de banques, 41
- syndicat de placement, 50
- taux actuariel, 20, 22, 69
- taux au jour le jour, 16
- taux d'intérêt, 25
- taux d'intérêt flottants, 45
- taux de refinancement, 12
- taux de rendement actuariel, 41, 58, 63, 67
- taux des Fed funds, 14
- taux directeurs, 12
- taux plafond, 12
- taux plancher, 12
- taux de l'échéance Constante 10 ans [TEC 10], 58
- théorie de la segmentation, 73
- théorie des anticipations, 70, 84
- Titres de Créance Négociables, 38
- vie moyenne, 96
- volatilité, 90, 101, 113