

Pratique des options

ECTS : 2

Volume horaire : 15

Description du contenu de l'enseignement :

1. Mise en situation concrète du métier de trading (market making)
2. Pricing des options complexes à partir de celui des options vanilles
3. Les risques dans la vraie vie
4. Au-delà des grecques

Compétence à acquérir :

- Comprendre les responsabilités d'un market maker d'options
- Maîtriser les implications concrètes au-delà des équations de la gestion d'un portefeuille d'options
- Acquérir des réflexes afin de repérer rapidement les principales sources de risques