

Pricing et risk management des options vanilles : modèles, volatilité et stratégies de couverture

Lien : https://innov-maroc.com/formation/pricing-et-risk-management-des-options-vanilles-modeles-volatilite-et-strategies-de-couverture

DURÉE	RÉFÉRENCE	CATÉGORIE
5 jours (35h)	**FA106**	**Finance de Marché**

INNOV MAROC

OBJECTIFS DE LA FORMATION

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

- Comprendre le fonctionnement des options vanilles
- Maîtriser les modèles de pricing des options
- Interpréter la volatilité implicite et ses effets
- Calculer et utiliser les Greeks
- Construire des stratégies optionnelles simples
- Gérer le risque lié aux options
- Mettre en œuvre des stratégies de couverture
- Analyser les scénarios de marché
- Optimiser un portefeuille d’options
- Développer une expertise en produits dérivés

POUR QUI ?

- Traders et analystes quantitatifs
- Gestionnaires de portefeuille
- Risk managers et contrôleurs des risques
- Banquiers d’investissement
- Structurers en produits dérivés
- Toute personne travaillant sur les marchés d’options

INNOV MAROC



Programme détaillé

1 / Introduction aux options vanilles

- Définition des options call et put
- Droits et obligations des contrats
- Rôle des options sur les marchés financiers

2 / Mécanismes de marché des options

- Marché organisé vs OTC
- Formation des prix et liquidité
- Participants du marché

3 / Modèle de valorisation des options

- Modèle de Black-Scholes-Merton
- Hypothèses et limites du modèle
- Calcul du prix théorique

4 / Volatilité et pricing des options

- Volatilité historique vs implicite
- Smile et skew de volatilité
- Impact sur la valorisation

INNOV MAROC

5 / Sensibilités des options (Greeks)

- Delta, gamma, theta, vega et rho
- Interprétation des sensibilités
- Gestion dynamique du risque

6 / Stratégies optionnelles de base

- Covered call et protective put
- Straddles et spreads
- Arbitrage simple

7 / Gestion du risque des options

- Risque de marché et de volatilité
- Effet de levier des options
- Gestion du risque de portefeuille

8 / Couverture (hedging) avec options

- Delta hedging
- Ajustement dynamique des positions
- Réduction de l’exposition au risque

9 / Stress testing et scénarios de marché

- Simulation de chocs de marché
- Analyse de sensibilité extrême
- Gestion des événements rares

10 / Études de cas pratiques

- Pricing d’options réelles
- Gestion de portefeuille optionnel

INNOV MAROC

- Analyse de stratégies de trading

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

08 au 12 Fév. 2027	Présentiel - Casablanca
05 au 09 Avr. 2027	Présentiel - Casablanca
31 Mai au 04 Juin 2027	Présentiel - Casablanca
26 au 30 Juil. 2027	Présentiel - Casablanca
20 au 24 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@innov-maroc.com
Web : https//www.innov-maroc.com

INNOV MAROC

INNOV MAROC — Tous droits réservés