**Compte rendu entretien 1 :**

Impact de la volatilité sur un forward : nul

Comment couvrir un Forward ?

On peut acheter en REPO pour avoir l’action et la revendre ensuite au taux REPO, on ne sera alors pas touché par les variations baissières de l’action.

Placer au taux sans risque pour couvrir r.

VBA : comment avoir la dernière cellule non vide d’une colonne ?

Sub derniere\_ligne\_d\_une\_colonne()

'

' derniere\_ligne\_d\_une\_colonne Macro

'

Cells(ActiveCell.Row, ActiviteCell.Column + 1).Select

Selection.End(xlDown).Select

Cells(ActiveCell.Row , ActiviteCell.Column -1).Select

Selection.End(xlUp).Select

End Sub

Quel est le code le plus optimal entre ça et ça ?

Python :

Compte-moi le nombre de 5 dans cette matrice.

Pour être optimal, faire une deuxième boucle for de longueurs variables si les lignes n’ont pas toutes la même longueur.

Actualité :

Bien suivre les cours et celui de la SG.

Site : stratégie-option

**Compte rendu entretien 2 :**

VaR formule : bien faire les (Si-Si-1)/Si-1 ou le log(Si/Si-1) pour avoir un %.

DL de f(x+a,y+b) à l’ordre 2, c’est pour les variations du PnL.

Brain teaser : Il y a 1 verres pleins d’eau et on a chacun un verre. Je commence par en prendre la moitié, puis tu prends la moitié de ce qu’il reste et ainsi de suite, on finit à combien ? 2/3 - 1/3

Vomma : =

Vanna: :=

**Compte rendu entretien 3 :**

**MACC à la base :**

Equipe RISQ et une TDA.

Risque plutôt PnL et Stress Test

TDA plutôt Analyse des Risques, grecques.

5à 8 par équipes et chacun 3 à 4 desks de trading donc 15-20 Traders.

Il faut automatiser les trucs répétitifs.

Si le trader a souvent la même demande, lui faire un report dayli quotidien.

Delta-hedge une option : explication du Theta négatif, se rapproche de la courbe donc quand on est Delta-hedger ça fait un theta négatif.

Il faut le spot réalise un vol calculé + que la volatilité implicite payée au départ pour gagner quand on est delta neutre (tout le temps). Voir les schémas.

Qu’est ce qu’un trader ? Couvres les ventes de la banque.

Explication d’un Autocall : ATHENA.

L’investisseur est short d’un PDI la dernière année.