Opzioni dalla A alla Z

Programma del corso

Lezione 1 – Introduzione alle opzioni

- Cosa sono le opzioni e come funzionano
- Differenza tra Call e Put
- Acquisto e vendita di opzioni
- Utilizzo delle opzioni: speculazione, copertura e rendimento
- Vantaggi e rischi dello strumento

Lezione 2 – Struttura e caratteristiche di un'opzione

- Strike price, scadenza e premio
- Valore intrinseco e valore temporale
- Opzioni In The Money, At The Money e Out Of The Money
- Lettura della catena delle opzioni

Lezione 3 – La formazione del prezzo di un'opzione

- Fattori che influenzano il premio
- Effetto del movimento del sottostante
- Effetto del tempo residuo
- Effetto della volatilità
- Concetto di valore e prezzo dell'opzione

Lezione 4 – Le greche delle opzioni

- Delta: sensibilità al movimento del sottostante
- Theta: effetto del passaggio del tempo
- Vega: effetto della volatilità
- Gamma: variazione del Delta
- Utilizzo delle greche nella gestione delle posizioni

Lezione 5 – La volatilità nelle opzioni

- Cos'è la volatilità
- Volatilità storica e implicita
- Volatilità alta e bassa
- Effetto della volatilità sul premio delle opzioni
- Quando è più conveniente comprare o vendere opzioni

Lezione 6 – Strategie direzionali di base

- Long Call
- Long Put
- Short Call
- Short Put
- Quando utilizzare strategie rialziste o ribassiste
- Rischi e caratteristiche delle strategie direzionali

Lezione 7 – Strategie con rischio definito

- Perché utilizzare gli spread
- Bull Call Spread
- Bear Put Spread
- Bull Put Spread
- Bear Call Spread
- Gestione del rapporto rischio/rendimento

Lezione 8 – Analisi dello scenario di mercato e scelta della strategia

- Identificazione del trend di mercato
- Relazione tra direzione del mercato e volatilità
- Scelta della strategia in base allo scenario operativo
- Approccio rialzista, ribassista e laterale

Lezione 9 – Strategie avanzate con le opzioni

- Covered Call
- Cash Secured Put
- Straddle
- Strangle
- Iron Condor
- Quando utilizzare strategie direzionali o neutrali

Lezione 10 – Selezione dell'opzione e costruzione della posizione

- Scelta della scadenza
- Scelta dello strike
- Effetto della leva
- Valutazione del premio
- Errori comuni nella scelta dei contratti

Lezione 11 – Gestione delle operazioni e controllo del rischio

- Gestione delle posizioni aperte
- Presa di profitto e gestione delle perdite
- Rolling delle opzioni
- Dimensionamento della posizione
- Regole di gestione del capitale

Lezione 12 – Metodo operativo e costruzione di una strategia personale

- Analisi del mercato
- Valutazione di direzione e volatilità
- Scelta della strategia
- Pianificazione dell'operazione
- Creazione di un approccio disciplinato al trading in opzioni