

Option Forum

Programma 2011

Blend Tower - Milano - sabato, 24 settembre 2011

Relatore	Sessione & Descrizione
8:45 – 9:30	<b>Accoglienza e Registrazione</b>
9:30 – 10:00	<b>Presentazione. Il secondo anno del Convegno Indipendente sulle Opzioni.</b>
9:30 – 11:00 Eugenio Sartorelli	<b>Opzioni e Trading Direzionale.</b> <i>Operare in modo direzionale: dall'acquisto semplice di Call/Put ai Vertical Spread, fino alle strategie più complesse. Aspetti definitivi e logiche di selezione. A seguire i criteri di scelta dell'option trader esperto per stabilire la scadenza e lo strike, indipendentemente dalla strategia in Opzioni adottata.</i>
11:00 – 11:30	<b>COFFEE BREAK</b> : pausa colazione offerta dall'Option Forum ai presenti.
11:30 – 12:30 Luca Stellato	<b>Opzioni su Valute: focus su EUR USD.</b> <i>Operare sul daily e sul weekly per cogliere i trend a grande ampiezza di prezzo e aumento di volatilità. Logiche tecniche di set-up e logiche statistico-quantitative di sviluppo del money management.</i>
12:30 – 13:00	<b>PRO TRADER PLUS:</b> presentazione di una nuova esclusiva piattaforma professionale realizzata dalla FX Bridge per il trading evoluto sulle opzioni, comprendente la parte di analisi sulle opzioni, analisi complessa di portafoglio e what-if scenario, risk management tools inclusi con margin calculator in tempo reale.
13:00 – 14:30	<b>LUNCH:</b> libero.
14:30 – 16:00	<b>INDICE DELLA VOLATILITA' ANCHE PER I</b>

**Orso Locatelli**

### **SINGOLI TITOLI.**

*Dallo scorso 7 gennaio, il CBOE ha annunciato il rilascio di nuovi indici di volatilità implicita su cinque sottostanti azionari: Google, Apple, Amazon, IBM e Goldman Sachs. Il valore sarà calcolato nello stesso modo in cui viene calcolato ora il VIX, l'indice di riferimento per la volatilità implicita delle opzioni dello S&P500. Analizzeremo la divergenza tra la volatilità del NASDAQ 100 (VXN) e quella di alcuni componenti chiave dell'indice come ad es. Apple, Google e Amazon. L'indice di volatilità su Goldman Sachs risulta estremamente interessante in caso di crisi finanziaria. Approfondiremo quindi anche questo particolare aspetto legato alla volatilità e alle strategie implementate con le opzioni. Prima con le opzioni weekly ed ora con gli indici di volatilità relativi a singoli sottostanti azionari, il CBOE è riuscito a ridurre l'ambito della analisi usuale della volatilità relativa al livello e al tempo . Questo significa un ulteriore passo in avanti verso la suddivisione della volatilità in tante volatilità specifiche.*

**16:00– 17:30**

**Luca Giusti**

### **MECCANIZZARE GLI AGGIUSTAMENTI NEL TRADING NON DIREZIONALE.**

*Intervenire su Strategie di Trading Non Direzionali quando il sottostante inizia ad accelerare in una delle due direzioni, non è sempre facile; questo intervento presenta come poter meccanizzare gli aggiustamenti su questo tipo di strategie (siano esse create utilizzando opzioni con scadenza mensile, settimanale o opzioni OTC) in condizioni di mercato avverse a questo tipo di operatività, attraverso l'impiego di un sistema di tipo volatility breakout.*

**17:30 – 18:00**

**OPTION FORUM GROUP:** entrare in **SIAT** a far parte del nostro gruppo di lavoro per diffondere la cultura delle Opzioni.