

Banking & Finance: Derivati I & Prodotti strutturati I

Offerta formativa ASG

Titolo / tematica	Derivati I & Prodotti strutturati I
Gruppo target	Gestori di patrimoni
Contenuti di apprendimento	<p>Il tema dei derivati spiega le proprietà e le tipologie essenziali di derivati, nonché i diversi tipi di operazioni a termine. Vengono anche presentate le opzioni basilari e discussi i fattori che determinano il valore delle opzioni.</p> <p>Il tema dei prodotti strutturati esamina la struttura, le principali caratteristiche, le aspettative degli investitori, così come le opportunità e i rischi di questa categoria di investimento.</p>
Luogo di apprendimento	Piattaforma di e-learning Fintelligence: https://fintelligence.fintelligence-net.com/
Durata di apprendimento	<p><u>Derivati I</u></p> <ol style="list-style-type: none">1. Nozioni di base (70 min)2. Opzioni (70 min)3. Componenti del prezzo dell'opzione (70 min)4. Valore dell'opzione (60 min) <p><u>Prodotti strutturati I</u></p> <ol style="list-style-type: none">5. Struttura e caratteristiche (80 min)6. Categorie di prodotto e rischi (80 min)7. Controllo di apprendimento (80 min)
Periodo	2 mesi
Obiettivi didattici	<p><u>Derivati I</u></p> <p><u>Nozioni di base</u></p> <ul style="list-style-type: none">• Dopo aver elaborato questo modulo, sarete in grado di spiegare il termine "derivati" e le loro caratteristiche,• definire i tipi di derivati,• distinguere le operazioni a termine tra opzioni, futures e forward,• spiegare le attività sottostanti dei derivati,• mostrare le diverse possibilità di negoziazione dei derivati,• spiegare i requisiti per l'acquisto e la vendita di derivati dal punto di vista del cliente. <p><u>Opzioni</u></p>

- Dopo aver elaborato questo modulo, sarete in grado di spiegare la procedura di un'opzione di acquisto e di vendita,
- spiegare le differenze tra una posizione lunga e una posizione corta relativamente alle opzioni,
- distinguere le quattro posizioni fondamentali, che il compratore e l'acquirente di un'opzione possono assumere,
- decidere, quando un'opzione deve essere esercitata o meno,
- calcolare i guadagni e le perdite relativamente alle opzioni,
- illustrare le diverse alternative di azione di un acquirente o di un venditore durante la durata di un'opzione.

Componenti del prezzo dell'opzione

- Dopo aver elaborato questo modulo, sarete in grado di spiegare da quali fattori dipende la definizione dei prezzi delle opzioni,
- decidere quali sono i fattori di influenza sono più importanti per una call o una put,
- spiegare in che modo le variazioni dei fattori di influenza incidono sul prezzo dell'opzione.

Valore dell'opzione

- Studiando questo modulo saprete: spiegare cosa s'intende per fair value o valore teorico di un'opzione;
- spiegare come viene calcolato il giusto prezzo dell'opzione utilizzando la formula di Black-Scholes;
- calcolare il prezzo corretto di un'opzione con l'ausilio di una tabella Excel o di un calcolatore di prezzo dell'opzione;
- spiegare il concetto di parità put-call di un'opzione e formulare delle considerazioni sulla creazione di valore di un'opzione.

Prodotti strutturati I

Struttura e caratteristiche

Dopo aver elaborato questo modulo

- avrete una conoscenza di base per l'utilizzo di prodotti strutturati nella consulenza di investimento,
- sarete in grado di comprendere, classificare e valutare i prodotti strutturati,
- sarete in grado di spiegare le caratteristiche strutturali essenziali e il funzionamento dei prodotti strutturati.

	<p><u>Categorie di prodotto e rischi</u></p> <p>Dopo aver elaborato questo modulo</p> <ul style="list-style-type: none"> • sarete in grado di distinguere fra loro i tipi di prodotti strutturati più importanti, • conoscerete la classificazione dei prodotti strutturati secondo la categorizzazione dell'Associazione Svizzera per prodotti strutturati (ASPS), • sarete in grado di descrivere le opportunità e i rischi dei tipi di prodotto nel colloquio con il cliente.
<p>Metodologia</p>	<p>Studio del modulo di e-learning interattivo con contenuti e video scopribili e controllo di apprendimento.</p>
<p>Controllo di apprendimento</p>	<p>I due test di apprendimento sono costituite da 15 a 20 domande a risposta multipla. Per superare i test occorre totalizzare almeno il 70% del punteggio massimo.</p>