

PROGRAMA DE ESPECIALIZACIÓN EN OPCIONES FINANCIERAS

7° EDICIÓN

Este curso es para ti



PRINCIPIANTE EN OPCIONES:

Si eres nuevo en el mundo de las opciones financieras, este curso te proporcionará los cimientos necesarios.



INVERSOR EN BUSCA DE DIVERSIFICACIÓN:

Si deseas diversificar tu cartera y aprender nuevas formas de inversión, este curso es para ti.



INVERSOR EN BUSCA ESTRATEGIAS MÁS SEGURAS:

Si quieres aprender a usar opciones para proteger tus inversiones, este curso te proporcionará las herramientas necesarias.



PROFESIONAL FINANCIERO:

Si trabajas en el campo financiero o deseas mejorar tu comprensión de las opciones financieras, este curso te brindará conocimientos esenciales.

¿Qué aprenderás en el curso?

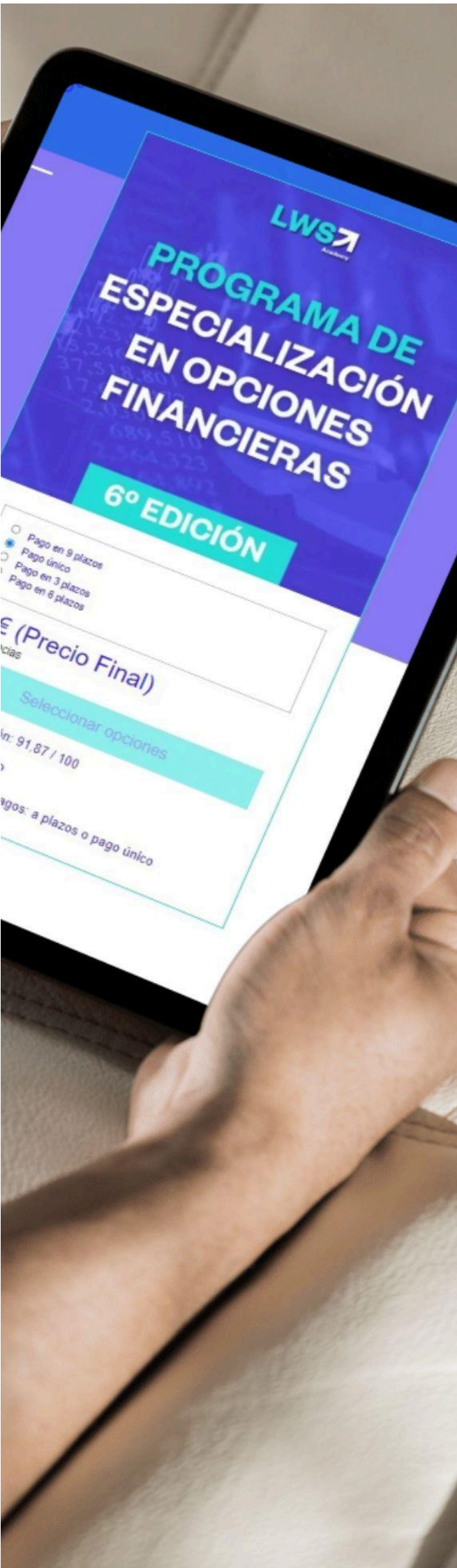
Vas a invertir en saber **gestionar tu riesgo.**

Vas a poder darle un **plus de rentabilidad a tu cartera.**

Vas a poder **cubrir tu cartera** ante situaciones de mercado que detectes.

Vas a poder **sacar partido y a manejar la volatilidad.**

Si en alguna ocasión **no has sabido si debes operar o no con opciones**, has seguido algún consejo de algún gurú y no ha salido como esperabas, este curso es para ti.



Plan de estudio

Veamos el plan de estudio del Programa completo, separado en dos partes:

1. FUNDAMENTOS ESENCIALES DE LAS OPCIONES FINANCIERAS

0. INTRODUCCIÓN AL CURSO.

- 0.1. ¿Qué vamos a aprender?
- 0.2. Opciones, perspectiva histórica y de mercado
- 0.3. Posibles uso de las opciones

1. INTRODUCCIÓN A LAS OPCIONES FINANCIERAS.

1.1. ¿Qué es una opción financiera?

- 1.1.1. ¿Qué es una opción financiera?
- 1.1.2. Ejemplo: contrato de arras
- 1.1.3. Beneficios y pérdidas del contrato de arras
- 1.1.4. Diferencias entre contratos de arras y Opciones
- 1.1.5. Test conocimiento 1

1.2. Tipos de opciones financieras

- 1.2.1. Tipos de opciones financieras
- 1.2.2. Ejemplo de venta de put(venta de una casa)
- 1.2.3. Test de conocimiento 2

1.3. Conceptos básicos

- 1.3.1. Introducción a los conceptos
- 1.3.2. Conceptos básicos
- 1.3.3. Conceptos básicos. DTE
- 1.3.4. Conceptos básicos: la cadena de opciones
- 1.3.5. Cadena de opciones en Interactive brokers
- 1.3.6. Test de conocimiento 3

2. FUNDAMENTOS DE LAS OPCIONES FINANCIERAS

2.1. Fundamentos de las opciones I

- 2.1.1. Exposición y Break Even

- 2.1.2. Exposición por operativa
- 2.1.3. Exposición: Apalancamiento vs Pérdida Máxima en Excel
- 2.1.4. In, At y Out The Money
- 2.1.5. Valor intrínseco y valor temporal I
- 2.1.6. Valor intrínseco y Valor temporal II
- 2.1.7. Test conocimiento 4

2.2. Fundamentos de las Opciones II

- 2.2.1. Distancia, Rentabilidad y ratio extra
- 2.2.2. La rentabilidad en Excel. Stock Option Channel
- 2.2.3. Apalancamiento
- 2.2.4. Garantías
- 2.2.5. Garantías como posición global
- 2.2.6. Test conocimiento 5

2.3. Fundamentos de las Opciones III

- 2.3.1. Cerrar, ejercer o expirar la opción I
- 2.3.2. Cerrar, ejercer o expirar la opción II
- 2.3.3. Cerrar, ejercer o expirar la opción en Interactive Brokers. Ventas de Opciones
- 2.3.4. Cerrar, ejercer o expirar la opción en Interactive Brokers. Compras de Opciones
- 2.3.5. Opciones Europeas y Americanas
- 2.3.6. Volumen y Open Interest
- 2.3.7. Liquidez y Tipos de órdenes
- 2.3.8. Split y Contraspit
- 2.3.9. Dividendos ordinarios, extraordinarios y las opciones
- 2.3.10. Diferencias entre opciones y acciones
- 2.3.11. Test conocimiento 6

2.4. Masterclass

- 2.4.1. Masterclass EN DIRECTO Fundamentos de Opciones
- 2.4.2. Masterclass Fundamentos Opciones ediciones anteriores I
- 2.4.3. Masterclass Fundamentos Opciones ediciones anteriores II

3. OPERATIVAS BÁSICAS CON OPCIONES

3.1. Introducción a las operativas básicas

3.2. Compra de Call

- 3.2.1. Compra de Call

- 3.2.2. Gráfico de riesgo en excel. Compra de Call
- 3.2.3. ¿Cuándo compramos una call?
- 3.2.4. Test de conocimiento 7
- 3.2.5. Mantener o deshacer posición. Compra de call
- 3.2.6. Apalancamiento en compra de Call
- 3.2.7. Interactive Brokers-Compra de Call
- 3.2.8. Riesgos y beneficios compra de Call
- 3.2.9. Leaps
- 3.2.10. Test de conocimiento 8

3.3. Venta de Call

- 3.3.1. Venta de Call
- 3.3.2. Gráfico de riesgo en excel. Venta de Call
- 3.3.3. ¿Cuándo vendemos una call?
- 3.3.4. Test de conocimiento 9
- 3.3.5. Beneficios y riesgos en Venta de Call
- 3.3.6. Mantener o deshacer posición Venta de Call
- 3.3.7. Rentabilidad en Venta de Call
- 3.3.8. Interactive Brokers en Venta de Call
- 3.3.9. Test de conocimiento 10

3.4. Compra/venta de Call

- 3.4.1. Juego de suma cero - Compra/Venta de Call
- 3.4.2. Interactive Brokers Compra/Venta Call en el broker

3.5. Compra de Put

- 3.5.1. Compra de put
- 3.5.2. Gráfico de riesgo en excel. Compra de put
- 3.5.3. ¿Cuándo compramos una put?
- 3.5.4. Test de conocimiento 11
- 3.5.5. Beneficios y riesgo de una compra de put
- 3.5.6. Mantener o deshacer posición en compra de put
- 3.5.7. Test de conocimiento 12

3.6. Venta de Put

- 3.6.1. Venta de Put
- 3.6.2. Gráfico de riesgo en excel. Venta de Put
- 3.6.3. Venta de put en excel
- 3.6.4. Test de conocimiento 13
- 3.6.5. Beneficios y riesgos en venta de put

3.6.6. Mantener o deshacer posición en venta de put

3.6.7. Test de conocimiento 14

3.7. Compra/venta de Put

3.7.1. Juego de suma cero - Compra/Venta de Put

3.7.2. Interactive Brokers Compra/Venta Put en el broker

3.8. Call y Put en la práctica

3.8.1. Consejos básicos en la práctica

3.8.2. Dashboard Options Tracker en Excel

3.9. Masterclass

3.9.1. Masterclass Operaciones básicas EN DIRECTO

3.9.2. Masterclass Operaciones básicas ediciones anteriores I

3.9.3. Masterclass Operaciones básicas ediciones anteriores II

4. OPERANDO CON OPCIONES EN INTERACTIVE BROKERS

4.1. Operativa de Opciones en Interactive Brokers

4.1.1. Introducción

4.1.2. Compra de Call

4.1.3. Venta de Call

4.1.4. Compra de Put

4.1.5. Venta de Put

4.1.6. Cierre de posiciones

4.1.7. Asignación de Compra de Call

4.1.8. Asignación de Venta de Opciones

4.1.9. Operar con acciones y opciones a la vez

4.1.10. Rolar opciones

4.1.11. Rolar opciones con APP IB

4.1.12. Option Wizard. Inteligencia Artificial en Interactive Brokers

4.1.13. Cartera del Curso

4.1.14. Operativa básica con opciones en la Trader Workstation de IB

4.1.15. Test de conocimiento 15

5. ESTRATEGÍAS BÁSICAS CON OPCIONES

5.1. Value Investing y las Opciones

5.1.1. Value Investing

5.1.2. Value Investing y venta de put

5.1.3. Value investing y venta de put en excel

- 5.1.4. Value Investing y venta de put CONCLUSIONES
- 5.1.5. Value Investing y Venta de Call I
- 5.1.6. Value Investing y Venta de Call II
- 5.1.7. Value investing y venta de call en excel
- 5.1.8. Value Investing y venta de call CONCLUSIONES
- 5.1.9. Test de conocimiento 16

5.2. Optimización Fiscal con Opciones

- 5.2.1. Estrategia de Fiscalidad Introducción
- 5.2.2. Estrategia de Fiscalidad Normativa
- 5.2.3. Estrategia de Fiscalidad - Caso Tsakos Energy I
- 5.2.4. Estrategia de Fiscalidad - Caso Tsakos Energy II
- 5.2.5. Estrategia de Fiscalidad II Compra Call ITM
- 5.2.6. Estrategia de Optimización Fiscal II. Caso Geo Group
- 5.2.7. Estrategia de Optimización Fiscal III Compra Put
- 5.2.8. Estrategia de Optimización Fiscal III Caso Scorpio
- 5.2.9. Test de conocimiento 17

5.3. The Wheel

- 5.3.1. The Wheel concepto
- 5.3.2. The Wheel ejemplo práctico
- 5.3.3. The Wheel conclusiones
- 5.3.4. Test conocimiento 18

5.4. Dividendos sintéticos con opciones

- 5.4.1. Dividendos sintéticos
- 5.4.2. Dividendos sintéticos caso Altria
- 5.4.3. Dividendos sintéticos caso Apple
- 5.4.4. Dividendos sintéticos conclusiones
- 5.4.5. Test conocimiento 19

5.5. Introducción a cobertura con Opciones

- 5.5.1. Cobertura de cartera
- 5.5.2. Cobertura de cartera excel
- 5.5.3. Cobertura de cartera conclusiones
- 5.5.4. Cobertura de posición
- 5.5.5. Cobertura de posición excel
- 5.5.6. Cobertura de posición conclusiones
- 5.5.7. Test conocimiento 20

5.6. Opciones Seeds (Semillas)

- 5.6.1. Seeds
- 5.6.2. Seeds en excel
- 5.6.3. Seeds conclusiones
- 5.6.4. Test conocimiento 21
- 5.7. Compra de Call financiada por Venta de Put**
 - 5.7.1. Compra call financiada por venta de put
 - 5.7.2. Compra call financiada por venta de put GEO
 - 5.7.3. Compra call financiada por venta put conclusiones
 - 5.7.4. Test conocimiento 22
- 5.8. Putwrite**
 - 5.8.1. PutWrite: ¿Qué es?
 - 5.8.2. PutWrite: Operativa
 - 5.8.3. PutWrite: Conclusiones
 - 5.8.4. Masterclass Javier Garcia Cervera PutWrite
- 5.9. Otras estrategias básicas**
 - 5.9.1. Rolar. La importancia de hacerlo bien**
 - 5.9.2. Comprar volatilidad: acciones binarias
 - 5.9.3. Comprar volatilidad: acciones binarias excel
 - 5.9.4. Comprar volatilidad: acciones binarias conclusiones
 - 5.9.5. Buy Writer
 - 5.9.6. Poor man covered call
 - 5.9.7. Poor man's covered call caso META
 - 5.9.8. Poor man's covered call conclusiones
 - 5.9.9. Test conocimiento 23
- 5.10. Masterclass**
 - 5.10.1. Masterclass Estrategias Simples en DIRECTO
 - 5.10.2. Masterclass Estrategias Simples ediciones anteriores I
 - 5.10.3. Masterclass Estrategias Simples ediciones anteriores II
 - 5.10.4. Masterclass Uso Opciones por un gestor profesional Gabriel Castro ediciones anteriores I
 - 5.10.5. Masterclass Uso Opciones por un gestor profesional Gabriel Castro ediciones anteriores II

EXAMEN INTERMEDIO

2 .EXPERTO EN OPCIONES FINANCIERAS

1. ESTRATEGIAS COMBINADAS CON OPCIONES

1.1. Introducción a las estrategias combinadas

1.2. Estrategias de tendencia

- 1.2.1. Vertical Spreads
- 1.2.2. Bull Spread - Call Spread
- 1.2.3. Call Spread. Caso práctico en Excel. Peabody \$BTU
- 1.2.4. Call Spread - Options Profit Calculator
- 1.2.5. Put Spread
- 1.2.6. Put Spread - Caso práctico en Excel \$NMM
- 1.2.7. Put Spread - Options Profit Calculator
- 1.2.8. Bear Spreads
- 1.2.9. Bear Put Spread
- 1.2.10. Túnel Alcista
- 1.2.11. Túnel Alcista en Option Profit Calculator y Excel. Conclusiones
- 1.2.12. Tunel Bajista
- 1.2.13. Tunel Bajista en Option Profit Calculator y Excel. Conclusiones
- 1.2.14. Test de Conocimiento 24

1.3. Estrategias de volatilidad

- 1.3.1. Straddles - Conos
- 1.3.2. Strangles - Cunas
- 1.3.3. Venta de Straddles
- 1.3.4. Venta de Straddles. Ejemplo
- 1.3.5. Venta de Strangles
- 1.3.6. Venta de Strangles. Ejemplo
- 1.3.7. Venta de Straddles y Strangles. Conclusiones
- 1.3.8. Venta de Strangle con acciones ganadoras
- 1.3.9. Jade Lizard
- 1.3.10. Jade Lizard con acciones ganadoras: ¿el combo perfecto?
- 1.3.11. Jade Lizard con acciones. Caso BTU
- 1.3.12. Masterclass sobre Straddles y Strangles con Enrique Castellano
- 1.3.13. Test conocimiento 25
- 1.3.14. Butterfly comprada
- 1.3.15. Butterfly comprada - Options Profit Calculator. Caso \$JNJ

- 1.3.16. Butterfly comprada con puts
- 1.3.17. Butterfly vendida
- 1.3.18. Butterfly vendida. Caso META
- 1.3.19. Butterfly vendida. Conclusiones
- 1.3.20. Iron Condor
- 1.3.21. Iron Condor - Option Profit Calculator. Caso \$NMM
- 1.3.22. Reverse Iron Condor
- 1.3.23. Reverse Iron Condor. Caso Nvidia.
- 1.3.24. Reverse Iron Condor. Conclusiones
- 1.3.25. Masterclass sobre Butterfye e iron Condor con Option Greg y Francisco
Javier Millán Martín
- 1.3.26. Calendar comprado
- 1.3.27. Calendar comprado - Option Profit Calculator. Caso \$NMM
- 1.3.28. Calendar vendido
- 1.3.29. Calendar vendido. Caso Nvidia
- 1.3.30. Calendar. Conclusiones
- 1.3.31. Test de Conocimiento 26

1.4. Estrategias mixtas

- 1.4.1. Diagonal Spreads
- 1.4.2. Diagonal Spread alcista
- 1.4.3. Diagonal Spread bajista
- 1.4.4. Diagonal Spread. Conclusiones.
- 1.4.5. Ratios Vertical Spread
- 1.4.6. Ratio Call Spread
- 1.4.7. Ratio Call Spread como estrategia reparadora
- 1.4.8. Ratio Put Spread
- 1.4.9. Ratio Backspread
- 1.4.10. Ratio Call Backspread - Caso Facebook \$META
- 1.4.11. Ratio Call Backspread - Conclusiones
- 1.4.12. Ratio Put Backspread
- 1.4.13. Ratio Put Backspread. Conclusiones
- 1.4.14. Test conocimiento 27

1.5. Otras estrategias combinadas.

- 1.5.1. Estrategias que tienen como objetivo replicar el pay-off del subyacente (stock replacement strategies).
- 1.5.2. Explicación de la estrategia ZEBRA (zero extrinsic value back ratio spread)

1.5.3. Comparativa entre las estrategias.

1.6. Excel práctico para estrategias combinadas. Excel Strategy Calculator

1.6.1. Excel Strategy Calculator

1.6.2. Taller en directo construcción Hoja Cálculo para estrategias con Opciones

1.7. Masterclass

1.7.1. Masterclass Estrategias Estrategias combinadas en DIRECTO

1.7.2. Masterclass Estrategias Estrategias combinadas ediciones anteriores

2. COBERTURAS CON OPCIONES

2.1. Introducción a las coberturas

2.1.1. Introducción coberturas

2.1.2. Por qué usar coberturas I

2.1.3. Por qué usar coberturas II

2.1.4. Por qué usar coberturas III

2.2. Covered Call

2.2.1. Estrategia Covered Call

2.2.2. Estrategia Covered Call - Ejemplo GEO

2.2.3. Estrategia Covered Call ITM- Ejemplo Palantir

2.2.4. Estrategia Covered Call Lateral y Lateral Bajista

2.2.5. Estrategia Covered Call - Recomendaciones y Riesgos

2.3. Cobertura con Compra de Put

2.3.1. Cobertura con Compra de Put

2.3.2. Cobertura con Compra de Put - Cuando usarla

2.3.3. Compra de Put y Moneyness

2.3.4. Cobertura con Compra de Put - Ejemplo Coca-cola

2.3.5. Bonus Track - Ejemplo Coca-cola

2.3.6. Cobertura con Compra de Put - Recomendaciones y riesgos

2.3.7. Test conocimiento 28

2.4. Collar

2.4.1. Collar - Concepto

2.4.2. Collar - ¿Cuándo usarla?

2.4.3. Collar - Ejemplo Monster Beverage

2.4.4. Collar - Desventajas

2.5. Bear Put Spread

2.5.1. Bear Put Spread - Concepto

2.5.2. Bear Put Spread - ¿Cuándo usarla?

2.5.3. Bear Put Spread - Caso Amazon

2.5.4. Bear Put Spread - Conclusiones

2.6. Put Ratio BackSpread

2.6.1. Put Ratio Back Spread - Concepto

2.6.2. Put Ratio Back Spread - ¿Cuándo usarla?

2.6.3. Put Ratio Back Spread - Caso Amazon

2.6.4. Put Ratio Back Spread - Conclusiones

2.6.5. Put Ratio Back Spread vs Bear Put Spread

2.6.6. Test conocimiento 29

2.7. Estrategia de pares

2.7.1. Estrategia de Pares - Concepto

2.7.2. Estrategia de Pares - Intel vs AMD

2.7.3. Estrategia de Pares - Netflix vs A3 Media

2.8. Cobertura de portfolio

2.8.1. Cobertura de Portfolio - Introducción

2.8.2. Cobertura de Portfolio - ETFs

2.8.3. Cobertura de Portfolio - Pasos a seguir

2.8.4. Cobertura de Cartera - Ejemplo I

2.8.5. Cobertura de Cartera - Ejemplo II

2.8.6. Test conocimiento 30

2.9. Masterclass

2.9.1. Masterclass Estrategias Estrategias combinadas en DIRECTO

2.9.2. Masterclass Estrategias Estrategias combinadas ediciones anteriores

3. POSICIONES SINTÉTICAS CON OPCIONES

3.1. Posición sintética de subyacente

3.1.1. Posición sintética. Definición y Posición sintética larga o comprada acciones.

3.1.2. Posición sintética larga o comprada acciones. Caso Inditex

3.1.3. Posición sintética corta o vendida de acciones.

3.1.4. Posición sintética corta o vendida de acciones. Caso Nvidia

3.1.5. Conclusiones posición sintética

3.2. Posición sintética de opciones

3.2.1. Posición sintética Long Call

3.2.2. Posición sintética Long Call. Caso META

- 3.2.3. Posición sintética Short Call
- 3.2.4. Posición sintética Short Call. Caso Charles Schwab
- 3.2.5. Posición sintética Long Put
- 3.2.6. Posición sintética Long Put. Caso Tesla
- 3.2.7. Posición sintética Short Put
- 3.2.8. Posición sintética Short Put. Caso Paramount
- 3.2.9. Posición sintética con opciones. Conclusiones
- 3.3. Posición sintética estrategias con opciones
 - 3.3.1. Posición sintética Iron Butterfly

4. VALORACIÓN DE OPCIONES. VOLATILIDAD. LAS GRIEGAS

4.1. Valoración de Opciones. Volatilidad. Las Griegas

- 4.1.1. Factores que afectan a la valoración de opciones
- 4.1.2. Cómo afecta el precio del subyacente a las Opciones
- 4.1.3. Cómo afecta el strike a la valoración de las Opciones
- 4.1.4. Cómo afecta el tiempo a vencimiento
- 4.1.5. Cómo afecta la volatilidad a las Opciones
- 4.1.6. Cómo afectan los dividendos a las Opciones
- 4.1.7. Cómo afecta el tipo de interés a las Opciones
- 4.1.8. Volatilidad
- 4.1.9. Volatilidad implícita
- 4.1.10. IV Index y IV Rank
- 4.1.11. Skew de Volatilidad
- 4.1.12. Masterclass Volatilidad de Enrique Castellanos
- 4.1.13. Test conocimiento 31

4.2. Las Griegas. Delta

- 4.2.1. Las griegas
- 4.2.2. Delta
- 4.2.3. Delta Casos Prácticos
- 4.2.4. Delta y el Moneyness
- 4.2.5. Delta neutral
- 4.2.6. Delta neutral - Caso Microsoft
- 4.2.7. Delta neutral - Cubriendo Opciones
- 4.2.8. Delta Neutral - Resúmen
- 4.2.9. Test conocimiento 32

4.3. Las Griegas. Gamma

- 4.3.1. Gamma
- 4.3.2. Gamma y Delta
- 4.3.3. Gamma - Valoración
- 4.3.4. Gamma - Valoración (Efecto paso del tiempo)
- 4.3.5. Gamma Risk en Interactive Brokers (Bonus Track)
- 4.3.6. Gamma - Valoración (La volatilidad)
- 4.3.7. Gamma y Delta Neutral
- 4.3.8. Gamma Squeeze
- 4.3.9. Test conocimiento 33

4.4. Las Griegas Theta

- 4.4.1. Theta
- 4.4.2. Theta y Moneyness
- 4.4.3. Theta y la volatilidad
- 4.4.4. Theta - Plazo idóneo para operar

4.5. Las Griegas. Vega

- 4.5.1. Vega

4.6. Valoración por Black Scholes

4.7. Black Scholes avanzado

4.8. La gestión del Market Maker: Delta Neutral

4.9. Masterclass

4.9.1. Masterclass de Enrique Castellano “Gestión de Riesgo con Delta Neutral y Gamma Scalping”

- 4.9.2. Masterclass Valoración opciones, volatilidad y griegas en DIRECTO
- 4.9.3. Masterclass Valoración opciones, volatilidad y griegas ediciones anteriores
- 4.9.4. Masterclass Volumen y Open Interest con Option Greg
- 4.9.5. Masterclass el COY y los Spreads con Option Greg

5. AJUSTE DE POSICIONES

5.1. Ajuste de posiciones

- 5.1.1. Introducción - Ajustes de Posiciones
- 5.1.2. Rolar la Posición
- 5.1.3. Críticas al Rolo
- 5.1.4. Ajustes Short Put
- 5.1.5. Ajustes Short Call

5.2. Ajustes por griegas

- 5.2.1. Ajuste por Delta

5.2.2. Ajuste por Theta

5.2.3. Ajuste por Vega

5.3. Ajustes de estrategias

5.3.1. Ajustes de estrategias I

5.3.2. Ajustes de estrategias II

5.3.3. Test 34

5.4. Transformación de posiciones

6. INDICADORES

6.1. Introducción:

6.1.1. Reflexión sobre el Market Timing

6.1.2. El uso de varios indicadores simultáneamente.

6.2. VIX

6.3. Concepto Contango vs backwardation

6.4. Put Call Ratio

6.5. IV Rank

6.6. IV Crush

6.7. Indicadores de Amplitud de mercado

6.7.1. Línea A/D Avance Descenso

6.7.2. Línea NH/NL New Hights New Lows

6.8. Fear & Greed Index

6.8.1. Componentes:

6.8.2. Market Momentum (S&P 500 and its 125-day moving average)

6.8.3. Stock Price Strenght (Net new 52-week highs and lows on the NYSE)

6.8.4. Stock Price Breadth (McClellan Volume Summation Index)

6.8.5. Put and Call Options (lo vemos con detenimiento antes).

6.8.6. Market Volatility (VIX respecto a su MM50)

6.8.7. Safe Haven Demand (Difference in 20-day stock and bond returns)

6.8.8. Junk Bond Demand (Yield spread: junk bonds vs. investment grade)

6.9. Bonus track Vix

6.9.1. ¿Qué es el Vix?

6.9.2. Contango y Backwardation

6.9.3. Estructura de los futuros y las operaciones del Vix

6.9.4. Principales errores de los traders de opciones cuando operan el Vix

6.9.5. Interpretación de la Volatilidad y Conclusiones

7. OPERATIVA PRÁCTICA AVANZADA:

- 7.1. Trade Workstation. Uso herramientas de la aplicación**
- 7.2. CONECTAR API INTERACTIVE BROKERS PARA SU USO CON OPCIONES.**
- 7.3. Calculadora de griegas en EXCEL**

8. FUTUROS SOBRE ÍNDICES Y ACCIONES

- 8.1. Precio Forward de un activo**
- 8.2. Concepto de base y posición abierta**
- 8.3. Futuros en contango y en backwardation**
- 8.4. Precio futuro de una acción y su tipo implícito**
- 8.5. Precio futuro sobre un índice y la transformación a puntos de índice de los dividendos**
- 8.6. Especulación y efecto apalancamiento**
- 8.7. Cobertura con futuros sobre acciones: Totales y parciales**
- 8.8. Cobertura con futuros sobre índice**
 - 8.8.1. Cálculo de la beta de una Cartera. Ratio de mínima varianza
 - 8.8.2. Ratio de cobertura
 - 8.8.3. Modificación de la sensibilidad de una cartera
- 8.9. Riesgos de las coberturas**
 - 8.9.1. Base
 - 8.9.2. Correlación
 - 8.9.3. Dividendos
 - 8.9.4. Redondeos
 - 8.9.5. Asimetría en la liquidación diaria de pérdidas y ganancias
- 8.10. Arbitrajes: Cash & Carry y Reverse Cash & Carry**
- 8.11. Time Spreads. Efecto del roll-over en contango y backwardation**

EXAMEN FINAL

¿Qué te ofrece el curso?



INICIO DE CURSO

El curso comenzará en marzo de 2025, de manera online y con profesionales expertos en la materia.



CLASES GRABADAS

Si no puedes asistir a las clases en directo, ¡no te preocupes! Quedan grabadas para volver a verlas en la plataforma.



SOPORTE 100% ONLINE

Contarás con un espacio de interacción en la plataforma para enviar tus dudas.



100% ONLINE

Podrás seguir las clases desde donde estés, puesto que el contenido completo es online por completo.

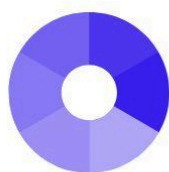
Invierte en **tu futuro**



Pago único

868€

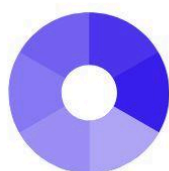
Precio final



Pago en 3 plazos

311€/mes

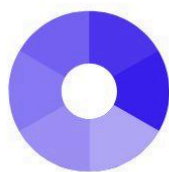
Total: 933€ Precio final



Pago en 6 plazos

160€/mes

Total: 960€ Precio final



Pago en 9 plazos

112€/mes

Total: 1.008€ Precio final