

Corso Ottimizzazione

Venerdì 16 maggio 2008 - Dalle 09:30 alle 13:30 - Aula B

Strumenti e metodologie di ottimizzazione del portafoglio

L'obiettivo

La ricerca del miglior rapporto tra rischio e rendimento e il conseguente concetto di "frontiera efficiente" ha evidenziato nel tempo alcuni limiti, primo fra tutti quello di ipotizzare l'esistenza di un unico scenario di riferimento, mentre la realtà attuale è più complessa.

Il corso affronta le metodologie più tradizionali per superare questi limiti, con la spiegazione del modello Black-Litterman e del Ricampionamento che consentono di impiegare una molteplicità di set di input e quindi di simulare diversi tipi di portafoglio, arrivando a definire quello ottimale.

Il corso è della durata di 4 ore + coffee break.

Il target

- ▶ Promotori finanziari e consulenti indipendenti
- ▶ Gestori fondi di fondi
- ▶ Gestori fondi pensione e di fondazioni
- ▶ Gestori di patrimoni previdenziali

Il programma

- ▶ Tra tradizione e innovazione: la selezione dei fondi e l'ottimizzazione del portafoglio
- ▶ La metodologia del Ricampionamento
- ▶ Black-Litterman attribution e performance measurement
- ▶ L'analisi del Value at Risk

I docenti

- ▶ Michele Gambera Ph.D., CFA, Chief Economist Ibbotson Associates
- ▶ Paolo Cucurachi, Docente Sda Bocconi Milano

Sede e costo del corso

Sede: Palacongressi - via della Fiera, 52 - Rimini

Costo: 400€ + IVA 20% - Per acquisti multipli sconto del 10%

Il costo del corso include il materiale didattico e coffee break

Per gli interventi in lingua inglese è previsto un servizio di traduzione simultanea