

Risk Management and Investment Performance in Asset Management

| | |
|--------------------|----------------------------------|
| Periodo del corso | Dal 9 gennaio al 6 febbraio 2025 |
| Durata | 20 Ore |
| Erogazione | In aula |
| Edizione | XVII Edizione |
| Livello | Avanzato |
| Termine iscrizioni | 16/12/2024 |

Data ultimo aggiornamento: 16/10/2024

L'attuale contesto internazionale, caratterizzato da tensioni geopolitiche, modesti tassi di crescita dell'economia mondiale, possibili ribassi di tassi di interesse grazie a contestuali ribassi dell'inflazione, favorisce un'alta volatilità dei mercati e pongono i Risk Manager davanti a sfide particolarmente critiche.

Per affrontare queste sfide si assiste a un ripensamento del ruolo del Risk Management nel settore dell'Asset Management: al fine di ottenere un'adeguata performance con un controllo sistematico del rischio, il Risk Management non costituisce più un semplice corollario della gestione patrimoniale, ma ne rappresenta il suo vero e proprio valore aggiunto.

Obiettivi del corso

Al termine del corso il partecipante è in grado di:

- implementare i principali metodi di misurazione del rischio di mercato
- adottare gli approcci adeguati per gestire il rischio di mercato, anche mediante l'uso di strumenti derivati
- analizzare la performance degli investimenti tenendo conto dei rischi

Il corso si rivolge a

Asset e Portfolio management

Consulente finanziario

Gestore patrimoniale

Risk management/Risk control

Trading/Tesoreria/Sala mercati

Tematiche trattate

Governance / Risk / Compliance, Prodotti finanziari e portfolio management

Costi

CHF 2400

Periodo

9/1/2025, 13.30 - 17.00

16/1/2025, 13.30 - 17.00

23/1/2025, 16.00 - 19.30

30/1/2025, 16.00 - 19.30

6/2/2025, 13.30 - 17.00

Programma

1. Introduzione ai rischi nel settore dell'Asset Management e nel banking
2. Quantificazione del rischio di mercato
3. Gestione e mitigazione del rischio di mercato
4. Asset and Liability Management
5. Misurazione e attribuzione risk-adjusted della performance
6. Casi pratici

Interventi

DOCENTI:

Nicola Carcano: Ph.D., Responsabile Asset Management, Phosphor Asset Management SA, Lugano,
Professore di Prodotti strutturati presso l'Università della Svizzera Italiana, Lugano

Contatto

Nicola Donadio

ndonadio@csvn.ch

091 961 65 20

© Fondazione Centro Studi Villa Negroni, tutti i diritti riservati