

Teorie del portafoglio e Strategic Asset Allocation

Periodo del corso	26 agosto 2025, 9.00 - 12.30
Durata	4 Ore
Erogazione	In aula
Edizione	I Edizione
Livello	Avanzato
Termine iscrizioni	18/07/2025

Data ultimo aggiornamento: 22/01/2025



La teoria del portafoglio di Markowitz fornisce una base concettuale per numerosi modelli di valutazione degli asset, tra cui il Capital Asset Pricing Model (CAPM) e i modelli multi-fattoriali. Questi modelli sono ampiamente utilizzati nell'analisi finanziaria e nella gestione degli investimenti.

Questo seminario, che costituisce il primo modulo del percorso formativo [Fit for Portfolio Construction](#), fornisce una comprensione completa delle strategie di allocazione degli asset in modo da creare dei portafogli ottimali che bene si adattano alle esigenze e agli obiettivi dei clienti.

Obiettivi del corso

Al termine del corso il partecipante è in grado di:

- comprendere gli elementi determinanti per un'efficace diversificazione del portafoglio
- delineare un'asset allocation strategica allineata al profilo di rischio del cliente e alle sue esigenze
- utilizzare i modelli mono fattoriali e multi fattoriali per valutare e gestire il rendimento e il rischio dei portafogli

Il corso si rivolge a

Asset e Portfolio management

Consulente alla clientela affluent SAQ

Consulenza clientela Wealth Management

Consulente finanziario

Certified Wealth Management Advisor CWMA SAQ

Gestore patrimoniale

Investment Specialist

Risk management/Risk control

Tematiche trattate

Prodotti finanziari e portfolio management

Costi

CHF 480

Programma

1. Rendimento e rischio
2. Strategic Asset Allocation
3. Portafogli ottimali
4. Modelli mono fattoriali
5. Modelli multi fattoriali
6. Casi pratici

Ulteriori dettagli

Valido ai fini del mantenimento della certificazione di consulente alla clientela bancaria della Swiss Association for Quality (SAQ) per i profili:

- Wealth Management Advisor (**CWMA**)
- Consulente alla clientela Affluent (**AFF**)

4 ore (competenze tecniche)

Interventi

DOCENTI:

Alberto Plazzi: Ph.D., Professore di Finanza, Università della Svizzera Italiana e Swiss Finance Institute, Lugano

Contatto

Nicola Donadio

ndonadio@csvn.ch

091 961 65 20

© Fondazione Centro Studi Villa Negroni, tutti i diritti riservati