

# Teorie del portafoglio e Strategic Asset Allocation

Periodo del corso	26 agosto 2026, 9.00 - 12.30
Durata	4 Ore
Erogazione	In aula
Edizione	III Edizione
Livello	Avanzato
Termine iscrizioni	14/08/2026

Data ultimo aggiornamento: 22/01/2026



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 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

Consulente alla clientela affluent SAQ

Certified Wealth Management Advisor CWMA SAQ

Gestione patrimoniale, Trustee & Asset management

Risk management

Consulenza Wealth Management

## 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 Piazzi:** Ph.D., Professore di Finanza, Università della Svizzera Italiana e Swiss Finance Institute, Lugano

# Contatto

Nicola Donadio

[ndonadio@csvn.ch](mailto:ndonadio@csvn.ch)

091 961 65 20

© Fondazione Centro Studi Villa Negroni, tutti i diritti riservati