

Assosim è lieta di presentarvi il corso di



FORMAZIONE DEI PREZZI A TERMINE E MERCATO REPO

*STRUMENTI A BREVE TERMINE PER LA GESTIONE DELLA TESORERIA E DEL
PORTAFOGLIO*

26 MAGGIO 2023
dalle 09.00 alle 17.30

RELATORI:

Roberto Rossi

Ettore de Cal – Banco BPM

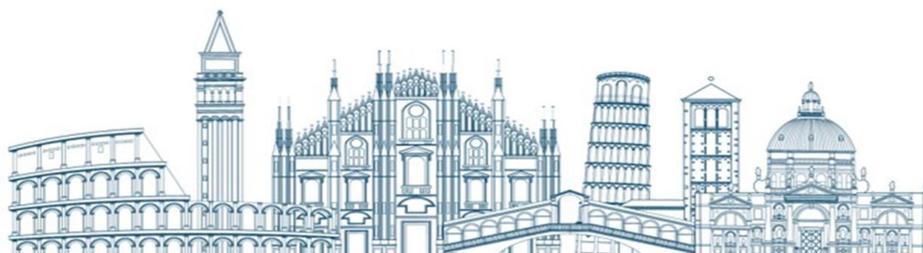
Mattia Leone e Mattia Rolfi - UniCredit

MACRO-ARGOMENTO:

Asset mgmt/Private Banking, Bond, Credit, Tesoreria/Liquidity Mgmt/Funding

DESTINATARI:

Asset Manager, Back Office, Risk Manager, Trader/Sales





DESCRIZIONE DEL CORSO

Domanda e offerta di moneta: recupero di concetti essenziali di macroeconomia. L'equilibrio di mercato e la definizione di tasso d'interesse. Il ruolo delle Banche Centrali. Dinamiche sottese alla dinamica dei prezzi dei titoli. Tasso di rendimento effettivo, duration e convessità: significato e implicazioni. Strumenti adottati dalle Tesorerie per il Funding attraverso l'uso del collaterale. Operatività del Repo market ed utilizzo della tesoreria come segmento strategico.

CONCETTI BASE

- Domanda e offerta di moneta. L'equilibrio di mercato.
- Rendimento effettivo, duration e convessità di un titolo.
- Gli strumenti collateralizzati dei mercati monetari. Il General Master Repurchase Agreement.

OBIETTIVI:

- Acquisire una visione globale delle meccaniche di mercato.
- Comprendere la relazione "prezzo-rendimento" di un titolo ed il significato di TRES.
- Conoscere il ruolo dei diversi attori di mercato e dell'utilizzo del collaterale.

Per iscrizioni o per ricevere maggiori informazioni contattare la Segreteria Assosim ai seguenti recapiti:

e-mail: assosim@assosim.it

telefono: 02 86454996

