

Assosim è lieta di presentarvi il corso di



LA GESTIONE DEL PORTAFOGLIO OBBLIGAZIONARIO

12 OTTOBRE 2023
dalle 09.00 alle 17.30

RELATORI:

Umberto Carugati

Roberto Rossi

Angelo Dipasquale - Equita SIM

MACRO-ARGOMENTO:

Asset mgmt/Private Banking, Bond

DESTINATARI:

Asset Manager, Trader/Sales



DESCRIZIONE DEL CORSO

Questo corso analizza i profili di rendimento e rischio di un portafoglio obbligazionario sino ad affrontare gli strumenti che permettono il controllo del rischio di tasso di interesse e della volatilità. Attraverso un'analisi delle strategie operative con le opzioni ed i derivati si potrà modificare istantaneamente il profilo di rischio e rendimento del portafoglio minimizzando i costi ed i rischi operativi. Il corso è rivolto a gestori private, family office, prop trader, gestori di fondi e Tesoreria assicurazioni e corporates.

CONCETTI BASE

- Analisi dei profili di rendimento e rischio di un portafoglio obbligazionario
- I diversi indici dei mercati obbligazionari e le modalità di gestione passiva e attiva
- Strategie operative con le opzioni ed i derivati

OBIETTIVI:

- Valutazione e selezione dei titoli obbligazionari; immunizzazione finanziaria
- Scelta degli indici dei mercati obbligazionari, strategie di duration neutral
- Utilizzo di futures e Opzioni

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

e-mail: assosim@assosim.it

telefono: 02 86454996

