



IL CONTROLLO DEI RISCHI FINANZIARI NELLA GESTIONE DEI PATRIMONI DEGLI INVESTITORI ISTITUZIONALI

DOTT. LUIGI ANTONELLI
(C.R.O. FONDO PENSIONE COMETA)



Il corso si prefigge di fornire allo studente le nozioni di base sugli strumenti attraverso i quali un Chief Risk Officer individua, monitora, gestisce e informa gli organi decisionali sui rischi finanziari di breve, medio e lungo periodo e le modalità attraverso le quali partecipa e contribuisce al più complessivo processo decisionale di un investitore istituzionale.



Partendo dalla descrizione e dalla valutazione delle principali tipologie di strumenti finanziari che compongono un portafoglio tipico di un investitore istituzionale, il corso affronta le tecniche di valutazione del rischio complessivo di portafoglio nelle sue componenti principali (interest, spread equity ecc.) anche attraverso le indicazioni fornite dalla Autorità di vigilanza delle Assicurazioni e dei Fondi pensione (Eiopa).

Per le valutazioni di lungo periodo verrà discusso un caso concreto che riguarda l'applicazione di un modello stocastico per la simulazione dei rendimenti delle asset class (Economic Scenario Generator) dai quali far derivare analisi di rischio sull'aleatorietà delle prestazioni previdenziali erogate da un Fondo Pensione.

**DOVE &
QUANDO**



Online, collegamento al seguente [link Meet](#)

A partire da **Venerdì 5 maggio 2023 (4 incontri)**
Orari: **15:30 - 18:30**

