

Principi per la costruzione, selezione e valutazione performance del portafoglio

PERCORSI: AGGIORNAMENTO IVASS – FORMAZIONE CONSOB

Area Tematica Ivass: Contrattuale e prodotti

Modulo Area Ivass: 5. Valutazione dei vantaggi e degli svantaggi delle diverse opzioni di investimento per gli Assicurati

Area di Competenza CONSOB: Lettera K art. 18 Linee Guida ESMA

Durata: 6 ore

Obiettivi:

A partire dalla teoria di Markowitz, il corso affronta e fornisce gli strumenti per poter capire come costruire un portafoglio di investimenti in grado di minimizzarne i rischi e massimizzarne il rendimento.

Contenuti:

Modulo 1 – Selezione e valutazione performance del portafoglio

- Asset allocation e modello Markowitz
- Modello Markowitz: portafoglio composto da 2 titoli
- Modello Markowitz: portafoglio composto da n titoli
- Valutazione della performance di portafoglio
- Gli indicatori di performance per il rischio
- Dinamiche dell'economia mondiale
- TEST di fine Modulo

Modulo 2 - Congiuntura economica e mercato assicurativo

- Performance degli strumenti assicurativi
- Le assicurazioni vita - parte 1
- Le assicurazioni vita - parte 2
- Il mercato assicurativo
- Il bilancio civilistico
- TEST di fine Modulo

TEST FINALE

Certificazione/Attestato: Report finali e Attestato di fruizione conformi alle disposizioni del Regolamento IVASS.

Prodotto da: Piazza Copernico

Contenuti a cura di: Assoreti Formazione

Docente: Duccio Martelli

Tecnologia di sviluppo: HTML5

Requisiti Tecnici minimi:

Acrobat Reader

I documenti PDF sono esportati per la versione 5 ma sono compatibili con le versioni successive di Acrobat Reader rilasciate fino alla data di aggiornamento di questo file.

Browser

- Internet Explorer 10
- Internet Explorer 11
- Mozilla Firefox
- Google Chrome

JavaScript abilitato

Blocco popup disabilitato

Risoluzione video minima

I corsi sono ottimizzati per una visualizzazione a 1024x768 su pc e tablet da almeno 7 pollici.

Altoparlanti o cuffie (in caso di prodotti multimediali)

Modalità di tracciamento dati - SCORM 1.2

CODICE CORSO: 0065_19_04