

MARTEDÌ 22 NOVEMBRE 2005

LA PERFORMANCE ATTRIBUTION NEL RISPARMIO GESTITO

SCHEMI VALUTATIVI ED ESPERIENZE OPERATIVE

PROGRAMMA

- 14:00 **Indirizzi di saluto**
- Autorità Accademiche
 - Dott. Gianni Ferrari, Vicepresidente AIAF
- 14:15 **G.Zambruno (Università Milano Bicocca)**
Introduzione ai lavori
- 14:30 **Paolo Balice (Direttore Investitori Sgr; socio Aiaf, membro dell'EIPC in rappresentanza dell'EFFAS)**
La Performance Attribution dal Benchmark al Total Return
- 15:00 **Winfried Hallerbach (Erasmus University, Rotterdam)**
Challenges in Fixed-Income Performance Attribution
- 15:45 **coffee break**
- 16:15 **Andrea Mariani – Luca di Galleonardo (MEFOP)**
*Performance Attribution mono-periodale e multi-periodale:
quali implicazioni per la scomposizione dell'extra-rendimento?*
- 17:00 **Federica Molteni (Verona Gestioni Sgr; socio Aiaf)**
La Performance Attribution per un fondo flessibile
- 17:30 **F. Odello (IW Bank) – A. Fasano (Univ. Salerno) – G. Fulci (Banca MPS)**
Relative-Conditional Drawdown at Risk: Rationales and Applications
- 18:00 **G. Astolfi – Samuele Marafin (co-responsabile Gruppo di lavoro GIPS AIAF)
Francesco Martinelli (co-responsabile Gruppo di lavoro GIPS – AIAF)**
*Top-Down Fixed-Income Performance Attribution: un approccio
uniperiodale e multiperiodale*
- 19:00 **Chiusura dei lavori**

Il Convegno, ideale proseguimento di quello svoltosi nel marzo 2004, intende presentare alcuni nuovi approcci teorici e recenti realizzazioni applicative delle metodologie di Performance Attribution con speciale attenzione ai portafogli fixed-income. Sarà anche l'occasione per annunciare un prossimo Quaderno AIAF dedicato a tali tematiche.

Edificio U6 – aula 4

ore 14:00 – 19:00

Università di Milano Bicocca
Piazza Ateneo Nuovo, 1 - 20126 Milano

La partecipazione al Convegno è libera e gratuita, previa registrazione via e-mail entro il 18/11/2005 a perfatt2005@unimib.it oppure info@aiaf.it

Come raggiungerci:
<http://www.unimib.it/ateneo/orientarsi/>