



### ***Contenuti dell'evento***

Il seminario si propone di affrontare, con un approccio pratico e concreto, alcuni temi cruciali per il trading sui mercati azionari. In particolare si rivolge a tutti gli operatori del settore che intendano perfezionare le proprie competenze attraverso un'analisi degli strumenti e delle tecniche necessarie ad affrontare il mercato utilizzando conoscenze e strumenti evoluti. Durante l'incontro verranno affrontate le criticità tipiche di un approccio direzionale beta-based che tenga conto sia dell'aspetto puramente tecnico nella gestione di un portafoglio equity attraverso l'utilizzo di tecniche di trend following e market scanning automatizzato, sia degli eventi importanti che influenzano la dinamica degli indici (rebalancing) e dei singoli titoli (special situations). Si analizzeranno poi le caratteristiche più rilevanti della gestione di un portafoglio complesso di opzioni, con particolare riferimento alle problematiche relative al book running ed al trading di volatilità lungo la curva.

### ***Destinatari dell'evento***

- Operatori della finanza (intermediari finanziari, promotori finanziari, trader, consulenti, assicuratori, ricercatori).
- Ricercatori e studiosi interessati allo studio dei mercati finanziari e delle strategie di investimento finanziario.

### ***Obiettivi dell'evento***

Approfondimento della gestione di un portafoglio di equity trading utilizzando parametri quantitativi e strumenti di analisi tecnica. Trend following e market scanning. Special situations e index rebalancing. Option portfolio management con trading sulla curva di volatilità.

**Programma dell'evento****Prima Giornata: venerdì 6 giugno 2014**

Orario 19:00                      Accoglienza

**Seconda Giornata: sabato 7 giugno 2014**

Orario 9:30 - 10:00              **Strumenti di gestione del portafoglio equity**

L'approccio al rischio

Docente:                              **Gian Marco Mensi**

Orario 10:00 - 13:00              **La gestione del portafoglio equity: parametri quantitativi e tecnici**

L'utilizzo dei parametri quantitativi (beta, R quadro, volatilità e VaR) applicati al FTSE-MIB - SC e GMM  
Tecnica di trend following - SC  
Market scanning - SC

Docenti:                                **Stefano Carrara**  
**Gian Marco Mensi**

Orario 13:00                        **Pranzo**

Orario 15:00 - 16:30              **Index rebalancing e special situations**

Analisi dell'indice FTSE-MIB e trading per il rebalancing: opportunità e rischi - GP  
Tattiche operative - GP  
Special situations - GP  
Il rischio liquidità nei momenti più delicati - GP e GMM

Docenti:                                **Guido Pardini**  
**Gian Marco Mensi**

Orario 19:00                        **Cena**

**Terza Giornata: domenica 8 giugno 2014****Orario 9:30 - 11:30****La gestione di un option portfolio**

Opzioni: greche e strategie operative - AP  
La gestione di un portafoglio complesso di opzioni - AP  
Problematiche di market making - AP

**Docente:**

**Alberto Poretti**  
**Gian Marco Mensi**

**Orario 11:30 - 13:00****Panel conclusivo**

Conclusione del Workshop.

**Docente:**

**Stefano Carrara**  
**Alberto Poretti**  
**Guido Pardini**  
**Gian Marco Mensi**

**Orario 13:00****Conclusione del workshop**

## **Note organizzative e condizioni**

### **Quota di partecipazione**

La quota di partecipazione è fissata in 500 euro (inclusa IVA 22%) e include sistemazione alberghiera presso la stessa struttura che ospita il workshop e pranzi, cena, e coffee break come previsto dal programma del workshop.

Si consiglia di provvedere alla prenotazione contestualmente all'iscrizione e comunque almeno quindici giorni prima della data d'inizio dell'evento. Oltre tale termine la nostra Segreteria Organizzativa farà il possibile per trovare le soluzioni più adeguate e convenienti.

La quota di partecipazione per eventuali accompagnatori è fissata in 200 euro (inclusa IVA 22%) e comprende la sistemazione alberghiera negli alloggi della Certosa (camere, appartamenti e suite) che possono ospitare da 2 a 5 persone e la partecipazione a tutti gli eventi previsti dal programma del workshop.

### **Modalità di iscrizione**

L'iscrizione s'intende perfezionata al momento del ricevimento, da parte di MAGIS, del modulo di iscrizione – da inviare via e-mail all'indirizzo mail@magisfinance.it - compilato in ogni sua parte. Il numero dei partecipanti è programmato e la priorità d'iscrizione è determinata dalla data di arrivo del modulo. La nostra Segreteria Organizzativa provvederà a inviare conferma dell'avvenuta iscrizione appena ricevuto il pagamento della quota di iscrizione.

### **Modalità di pagamento**

La quota di partecipazione deve essere versata all'atto della presentazione della richiesta di iscrizione e in ogni caso prima dell'effettuazione dell'intervento formativo tramite bonifico bancario intestato a:

Cognito s.r.l.

BNL BNP PARIBAS Firenze Ag.4

IT40P0100502970000000000434

Causale: Workshop MAGIS

Assegno bancario non trasferibile o circolare intestato a Cognito s.r.l.

Verrà spedita fattura quietanzata intestata secondo le indicazioni fornite.

### **Crediti formativi**

Al termine dell'intervento formativo sarà rilasciato ai partecipanti l'attestato di partecipazione nominativo.

### **Diritto di recesso e modalità di disdetta**

E' attribuita ai partecipanti la facoltà di recedere ai sensi dell'art. 1373 c.c. Il recesso dovrà essere comunicato in forma scritta almeno sette giorni prima della data di inizio dell'evento formativo. Qualora la disdetta pervenga oltre tale termine o qualora si verifichi di fatto con la mancata presenza al corso, la quota di partecipazione sarà addebitata per intero e sarà inviato al partecipante il materiale didattico. In qualunque momento il nominativo del partecipante e degli eventuali accompagnatori potranno essere modificati o sostituiti, comunicando il nuovo nominativo alla nostra Segreteria Organizzativa.

### **Variazioni di programma**

MAGIS, per ragioni eccezionali e imprevedibili, si riserva di annullare o modificare la data dell'intervento formativo, dandone comunicazione agli interessati entro tre giorni dalla data di inizio prevista. In tali casi le quote di partecipazione pervenute verranno rimborsate, con esclusione di oneri o obblighi a carico di MAGIS. MAGIS si riserva inoltre, per ragioni sopravvenute e per cause di forza maggiore, di modificare l'articolazione dei programmi e sostituire i relatori previsti con altri relatori di pari livello professionale.

### **Prenotazione alberghiera**

Su richiesta dei partecipanti o in caso di esaurimento degli alloggi disponibili, la Segreteria Organizzativa potrà provvedere alla prenotazione alberghiera a condizioni privilegiate presso strutture esterne che ospita l'evento formativo. Si consiglia di provvedere alla prenotazione almeno dieci giorni prima della data di inizio dell'evento. Oltre tale termine la nostra Segreteria Organizzativa farà il possibile per trovare le soluzioni più adeguate e convenienti.

Per ulteriori informazioni o necessità è possibile contattare la Segreteria Organizzativa al cellulare 3492454058 o all'indirizzo mail@magisfinance.it