

Quando la **matematica** diventa una strategia

Si terrà a Venezia la settima edizione del convegno internazionale sulle metodologie Quantitative che negli anni è cresciuto a tal punto da attirare in Italia accademici e *practitioner* di tutto il mondo. Nella splendida cornice veneziana, in un palazzo storico nel cuore di una delle più belle città del mondo, verrà organizzato da **DIAMAN SIM**, società di consulenza che fa delle strategie quantitative il suo *core business*, un convegno di due giorni dove si farà il punto dello stato dell'arte delle metodologie matematiche applicate alla finanza. Abbiamo chiesto a **Daniele Bernardi**, amministratore delegato di DIAMAN SIM, a chi sia dedicato un evento come il *QUANT2012* che si svolgerà il prossimo 9 e 10 febbraio: "Il convegno è particolarmente indicato per i gestori di fondi e gestori di secondo livello, oltre ai *risk manager* e a tutti gli investitori istituzionali, come fondi pensione, fondazioni, tesorerie di banche, poichè oltre ad aggiornare su gli ultimi modelli quantitativi, ci sono diversi interventi molto utili per le scelte strategiche che ogni giorno chi opera nella finanza è tenuto a fare" ricorda l'a.d. di DIAMAN SIM, che il 9 pomeriggio festeggerà il suo decimo anniversario.

Il convegno è di carattere nazionale o internazionale?

Da ormai tre anni il *workshop* è in lingua inglese per favorire gli stranieri che sempre più numerosi vengono in Italia per assistere al nostro convegno; riteniamo che quest'anno la partecipazione degli esteri supererà un terzo degli iscritti, e questo ci rende particolarmente orgogliosi, poichè significa che riusciamo con i nostri contenuti ad attirare un pubblico raffinato e difficile.

Ci tengo a precisare comunque che viene offerto un servizio di traduzione simultanea in Italiano per coloro che "masticano" poco la lingua inglese.

Chi saranno i *key speaker* quest'anno?

Quest'anno oltre alla riconferma Paul Wilmott, guru dei quantitativi che conta oltre 80.000 seguaci per il mondo, ci saranno Andrew Kumiega, dell'Illinois Institute of Technology di Chicago, Javier Estrada del IESE Business school di Barcellona, Claudio Albanese del King College di Londra, Ruggero Bertelli dell'università di Siena, Francesco Corielli della Bocconi e Marco Corazza di Ca' Foscari che giocherà in casa.

Questi sono i *key speaker* accademici, poi vengono i *practitioner*, ovvero gli esperti che

sul campo si conquistano giorno per giorno il diritto di essere considerati quantitativi d'eccellenza, e parlo di Giovanni Beliossi di FGS Capital, Roberto Violi di Banca d'Italia, David Hamilton di Moody's e negli ultimi giorni si è aggiunto anche Marcello Minenna, responsabile delle metodologie quantitative della Consob, oltre a tutti gli altri che si possono vedere sul sito www.quant.it.

Per chi mastica "quantitativo" questi nomi sono altisonanti, può anticiparci qualcosa sugli argomenti che tratterete?

Verrà presentata in anteprima la strategia che noi chiamiamo MATHEMATICS 3.0, ovvero una strategia innovativa basata su tre frequenze diverse di investimento, ad un'ora, ad un giorno e ad una settimana, che noi utilizziamo sul comparto della DIAMAN Sicav.

Ma si parlerà anche di *high frequency trading*, di *rating* impliciti, di strategie di gestione basate su modelli di analisi dei componenti indipendenti (ICA) di rischi di controparte e rischi sistemici, di *trading* algoritmico ed altro. Ma questi sono solo alcuni dei punti di un programma che è veramente ricco.

di Maurizio Canavesi



Daniele Bernardi,
DIAMAN SIM

**A inizio febbraio
il Quantitative
Asset & Risk
Management
Workshop 2012.
A Venezia
la 7ª edizione**