

GLI ASSET ILLIQUIDI NEI PORTAFOGLI DELLA CLIENTELA ISTITUZIONALE

EVIDENZE EMPIRICHE NEL COMPARTO DEL PRIVATE EQUITY

SDA Bocconi
SCHOOL OF MANAGEMENT

PE LAB

PRIVATE EQUITY
FINANZA PER LA CRESCITA

10.05.2023

Ore 17.30 • 20.00

Evento presso
Sala Conferenze
Museo Ninfeo
Fondazione ENPAM
P.zza Vittorio Emanuele II, 78
00185 - Roma

Gli asset illiquidi stanno assumendo, sia nella gamma prodotti dei principali asset managers, sia nei portafogli della clientela istituzionale, un peso via via crescente.

Il convegno si pone l'obiettivo di riflettere su:

- le difficoltà che si incontrano nel **coniugare asset class liquide ed illiquide**;
- le soluzioni che si possono adottare in sede di **asset allocation** iniziale;
- le modalità operative per il **monitoraggio del rischio** e per la valutazione dell'**adeguatezza dei portafogli** della clientela istituzionale;
- le opportunità per la clientela istituzionale.

Prosegue l'attività di ricerca del **Private Equity Lab** di SDA Bocconi School of Management per discutere problemi ed opportunità di chi opera sul mercato.

17.30 - APERTURA DEI LAVORI

17.35 - IL MERCATO DEL PRIVATE EQUITY: VALORI, PREZZI, RENDIMENTI

Valter Conca, Direttore Private Equity Lab,
Professor SDA Bocconi School of Management

17.45 - LA STIMA DEL RENDIMENTO, DEL RISCHIO E DELLE
CORRELAZIONI DELLE ASSET CLASS ILLIQUIDE

Roberto Botter, Partner e AD di Quantyx

18.00 - LE ASSET CLASS ILLIQUIDE NEI PORTAFOGLI DELLA CLIENTELA
ISTITUZIONALE: I PROBLEMI DA AFFRONTARE

Emanuele Maria Carluccio, SDA Bocconi Professor e partner Benchmark & Style

18.15 - PRIVATE MATTERS: OPPORTUNITÀ IN UN CONTESTO DI
INCERTEZZA

Karim Leguel, Head Private Market Distribution, Fidelity International

18.30 - IL DEBITO IMMOBILIARE COME CHIAVE DELLA DIVERSIFICAZIONE

Luca Simoncelli, Investment Strategist, Invesco

18.45 - TAVOLA ROTONDA: IL PUNTO DI VISTA DEI PLAYER DEL MERCATO

Coordina: **Emanuele Maria Carluccio**, SDA Bocconi Professor e partner Benchmark & Style

Intervengono:

Karim Leguel, Head Private Market Distribution, Fidelity International

Alberto Luchini, Chief Investment Officer, Poste Vita

Alberto Oliveti, Presidente, Fondazione ENPAM

Giuseppe Santoro, Presidente, Inarcassa

Luca Simoncelli, Investment Strategist, Invesco

19.45 - Q&A

NETWORKING COCKTAIL

Partecipazione gratuita **in presenza** previa [registrazione online](#)

PARTNER ISTITUZIONALI

BPER:
Banca

F **Fidelity**
INTERNATIONAL

MCP.
Mindful Capital Partners

QUANTYX [YK]

RUSSO DE ROSA ASSOCIATI
STUDIO LEGALE E TRIBUTARIO

X **Xenon**
Private Equity

CON IL CONTRIBUTO DI

Invesco