

# PORTAFOGLI PER L'INVESTITORE

Regular Price

Prezzo: **29,90 €** Special Price  
**28,41 €**



Codice	9788836008230
Tipologia	Libri
Data pubblicazione	19 set 2022
Reparto	Economia, LIBRI
Autore	Giusti Luca
Editore	Hoepli

## Descrizione

---

Il libro spiega come costruire dei portafogli di investimento in azioni ed ETF impiegando dei modelli quantitativi che sono alla portata di tutti, superando le tradizionali logiche di asset allocation (60/40, All Season, Permanent Portfolio, Golden Butterfly) e andando alla scoperta di modelli dinamici di allocazione del capitale (risk scaling, risk parity, minimum correlation, optimal portfolio, ranking based). Si tratta di un volume ideale per l'investitore che è alla ricerca di valide metodologie operative che consentano di investire il proprio capitale con un orizzonte temporale di medio termine.

L'autore descrive i fattori sui quali occorre agire per poter generare un extra rendimento, spiega come implementare portafogli rotazionali con l'impiego di modelli di selezione (momentum, low beta, value/growth) e illustra come neutralizzare il rischio di cambio e controllare il rischio di mercato impiegando modelli di regime switching (Risk On/Off).

Ogni modello è stato analizzato effettuando delle simulazioni su dati storici di diverse decine d'anni, tenendo conto dei costi di transazione e della fiscalità.

L'ultima parte del libro accompagna il lettore nella simulazione del proprio Lifetime plan, misurandone la sostenibilità e l'adeguatezza per poter raggiungere i propri obiettivi finanziari.

Prefazione di Gabriele Belleli. Introduzione. Modelli di Asset Allocation Statica: Un portafoglio azionario non è la scelta migliore che puoi fare - Asset allocation statica - La realtà è un'altra cosa - I lazy portfolio. Modelli di Asset Allocation Dinamica: Asset allocation dinamica - Modelli quantitativi di selezione basati sul momentum - Modelli quantitativi di selezione basati su altri factor. Portafogli per l'investitore: La costruzione di un portafoglio - La gestione del rischio di mercato - Lifetime plan. Conclusioni.

Rimaniamo a disposizione per qualsiasi ulteriore chiarimento allo 0461.232337 o 0461.980546 oppure via mail a : [servizioclienti@libriprofessionali.it](mailto:servizioclienti@libriprofessionali.it)  
www.LibriProfessionali.it è un sito di Scala snc Via Solteri, 74 38121 Trento (Tn) P.Iva 01534230220

