

COMUNICATO STAMPA

SYZ Asset Management annuncia la creazione di un Comitato Consultivo Scientifico per migliorare sempre più le strategie sistematiche

Ginevra, 22 novembre 2018 - SYZ Asset Management (“SYZ”), la società di gestione per investitori istituzionali del Gruppo SYZ, ha creato un innovativo Comitato Consultivo Scientifico per migliorare la qualità delle sue strategie d’investimento sistematiche. Il nuovo Comitato Consultivo beneficerà delle idee e delle prospettive di due importanti accademici, Amit Goyal della HEC di Losanna e Victor DeMiguel della London Business School.

Questa iniziativa pionieristica, che fonde le competenze in materia di gestione patrimoniale con il rigore accademico, cercherà di individuare segnali allocativi del mercato per le strategie sistematiche¹ di SYZ. La ricerca si concentrerà sull’elaborazione di algoritmi innovativi per la selezione di nuovi segnali di investimento, contribuendo all’elaborazione di nuove strategie sistematiche e migliorando i processi esistenti di costruzione e ribilanciamento del portafoglio.

La scienza dei rendimenti

Il Comitato Consultivo Scientifico è composto da Amit Goyal e Victor DeMiguel, oltre che da tre membri del team SYZ Quantitative Investment Solutions: Guido Bolliger, Claude Cornioley e Benoît Vaucher. SYZ Asset Management è una delle poche case d’investimento svizzere a sfruttare intensamente le competenze accademiche per migliorare la qualità delle sue soluzioni d’investimento. Questa iniziativa mira inoltre a stringere legami più forti con il mondo accademico, e a creare uno scambio dinamico di idee.

Il professor Goyal è esperto in materia di asset pricing empirico e la sua ricerca si concentra prevalentemente sui determinanti dei rendimenti delle attività finanziarie. Il professor DeMiguel, invece, si dedica alla progettazione e all’analisi dei metodi di costruzione del portafoglio.

All'avanguardia dell'innovazione

Nel settore degli investimenti, le grandi innovazioni sono partite tutte dalla ricerca accademica. Markowitz ha fatto da apripista con il suo lavoro pionieristico sulla diversificazione del portafoglio, ma il percorso è continuato fino ad arrivare ai più recenti sviluppi nel campo dei premi di rischio o degli algoritmi di apprendimento automatico. Pertanto, un fattore chiave per il successo degli investimenti è la capacità di traslare la ricerca accademica al lavoro sul campo ed essere sempre aggiornati sui suoi sviluppi più recenti. La rapidità delle innovazioni sui mercati finanziari impone al team di investimento di perfezionare costantemente i metodi di investimento sistematico, un compito che sarà rafforzato dalla contribuzione del Comitato Consultivo.

In riferimento alle assunzioni e alla creazione del Comitato Consultivo, Guido Bolliger, Portfolio Manager e Co-Head of Quantitative Investment Solutions, ha commentato: *“In SYZ Asset Management siamo molto lieti di accogliere Amit e Victor tra i membri del Comitato Consultivo. Il solido background accademico che hanno maturato nel campo della ricerca consentirà di essere in prima linea nell’innovazione delle strategie sistematiche e di stringere nuove relazioni con il mondo accademico.”*

¹ Tra le strategie sistematiche di SYZ vi sono i fondi *OYSTER Multi-Asset ActiProtect*, *OYSTER Equity Premia Europe* e *OYSTER Equity Premia Global*.

Biografie

Amit Goyal è professore di Finanza all'Università di Losanna e titolare di una Cattedra Senior all'SFI dal 2008. Le sue ricerche sono state pubblicate sulle principali riviste finanziarie mondiali e sulla stampa internazionale. Partecipa regolarmente in qualità di relatore alle maggiori conferenze accademiche in ambito finanziario. La sua ricerca si concentra principalmente sull'asset pricing empirico.

Attualmente il professor Goyal e il suo coautore stanno riesaminando la strategia del momentum per serie temporali (TS) di recente introduzione. Gli autori mostrano come la strategia TS sia di fatto una combinazione della strategia di momentum cross-section (CS) tradizionale e di un investimento net-long, variabile nel tempo, sul mercato. I risultati indicano che le strategie TS non identificano meglio delle CS gli asset che sovra- o sottoperformeranno il mercato.

Victor DeMiguel è professore di Management Science and Operations alla London Business School. La ricerca del professor Victor DeMiguel si concentra sulla progettazione e l'analisi di modelli quantitativi per il processo decisionale manageriale e sulla loro applicazione alla selezione dei portafogli finanziari e alla modellizzazione della concorrenza.

Il professor Victor DeMiguel insegna Modellizzazione finanziaria e Analisi decisionale e del rischio nell'ambito di programmi MBA, nonché Teoria e applicazioni dell'ottimizzazione in un seminario di dottorato. È altresì responsabile del modulo di Processo decisionale strategico per l'Advanced Development Programme of Executive Education. È stato insignito dei premi Junior Faculty Teaching Award per il 2003/2004 e Outstanding Core Course Teaching Award per il 2008/2009 alla London Business School.

Gli articoli del professor DeMiguel sono stati pubblicati sulle principali testate settoriali, tra cui *Management Science*, *Operations Research* e *Mathematics of Operations Research*. Uno dei suoi articoli più famosi è stato premiato con il Best Paper Award dell'Institute for Quantitative Investment Research e pubblicato su *The Review of Financial Studies*.

Il professor DeMiguel offre consulenza a diverse società, tra cui ENDESA, Iberdrola e McKinsey & Company.

Guido Bolliger è entrato a far parte di SYZ nel gennaio del 2015 come Co-Head del team Quantitative Solutions di SYZ Asset Management a Ginevra. Precedentemente aveva lavorato per otto anni in Olympia Capital Management a Parigi, con il ruolo prima di Head of Quantitative Analysis and Risk Management e poi di Chief Investment Officer. Guido Bolliger vanta un'esperienza di oltre 15 anni nel campo dell'analisi quantitativa e della gestione del portafoglio.

Ha conseguito un dottorato di ricerca in Economia finanziaria presso l'Università di Neuchâtel e lo Swiss Financial Institute, una laurea di secondo livello in Economia e finanza presso l'Università di Ginevra e una laurea di primo livello in Economia aziendale presso l'Università di Neuchâtel.

Dal 2006 è docente di Risk Management all'Università di Neuchâtel, oltre ad aver insegnato in diversi corsi di formazione manageriale all'Università di Ginevra e nel programma di certificazione FAME. La sua attività si concentra in particolare sul rischio quantitativo e la gestione di portafoglio.

Claude Cornioley è entrato a far parte di SYZ nel gennaio del 2015 come Co-Head del team Quantitative Solutions di SYZ Asset Management a Ginevra. In precedenza è stato Partner di Dynagest SA, in cui è entrato nel 1999 come Manager. Responsabile del monitoraggio degli indici, ne ha migliorato la gestione fino a febbraio 2013. Prima di Dynagest SA, Claude Cornioley è stato nominato Manager di Synchrony Asset Management nel 1998. Prima ancora, nel 1994, è entrato a far parte di Banque Cantonale de Genève, dove ha partecipato alla creazione di Synchrony SA e ha sviluppato prodotti indicizzati su un ampio spettro di mercato.

Dal 1997 Claude Cornioley insegna nell'ambito del Certificate of Advanced Studies in Quantitative Portfolio Management presso l'Università di Ginevra. È stato Visiting Scholar per due anni presso l'Università della California, a Berkeley. Claude Cornioley ha conseguito un dottorato di ricerca in Finanza presso l'Università di Friburgo.

Benoît Vaucher è Portfolio Manager presso SYZ Asset Management a Ginevra dal 2017 e membro del team Quantitative Investment Solutions. Prima di entrare a far parte di SYZ, ha lavorato per tre anni in Lombard Odier Asset Management come Portfolio Manager. Dal 2010 al 2014 ha lavorato presso Unigestion SA come Quantitative Analyst. Benoît Vaucher ha conseguito un dottorato di ricerca in Fisica presso l'Università di Oxford.

Per ulteriori informazioni, contattare:

Leila Bernasconi
Tel.: +41 (0)58 799 1542
E-mail: leila.bernasconi@syzgroup.com

Fonti:

<http://www.hec.unil.ch/agoyal/>
<http://sfi.ch/node/90>
<http://faculty.london.edu/avmiquel/>
<https://www.london.edu/faculty-and-research/faculty/profiles/d/demiquel-v>

Nota per la redazione

Informazioni sul Gruppo SYZ

Fondato nel 1996 a Ginevra, SYZ è un gruppo bancario svizzero che sta registrando una crescita robusta, dedicandosi esclusivamente alla gestione patrimoniale tramite due aree di attività complementari: banca privata di alto profilo e gestione patrimoniale. SYZ propone agli investitori privati e istituzionali uno stile di investimento basato sulla gestione attiva e la gestione del rischio e orientato alla performance assoluta. Il Gruppo dispone di un patrimonio consistente e può operare come società indipendente in virtù della struttura di azionariato familiare.
www.syzgroup.com

Informazioni su SYZ Asset Management*

SYZ Asset Management, l'entità di gestione patrimoniale istituzionale del Gruppo SYZ, fornisce soluzioni d'investimento a investitori istituzionali e intermediari finanziari. Fondata su un approccio basato su solide convinzioni, le strategie di SYZ Asset Management sono concepite per soddisfare i requisiti di portafoglio e di gestione del rischio degli investitori esigenti. SYZ Asset Management offre conti gestiti e diverse gamme di fondi di investimento, tra cui i Fondi OYSTER.
www.syzassetmanagement.com

*Qualsiasi riferimento a SYZ Asset Management nel presente documento deve essere interpretato come un riferimento a una o più entità giuridiche, elencate di seguito, in base alla particolare giurisdizione in cui il documento viene pubblicato, subordinatamente ai prodotti e ai servizi d'investimento menzionati nel presente resi disponibili a potenziali investitori o categorie di investitori in tali giurisdizioni: SYZ Asset Management (Luxembourg) SA, SYZ Asset Management (Suisse) SA, SYZ Asset Management (Europe) Limited, SYZ (France) SASU.

Informazioni sui Fondi OYSTER

OYSTER è una gamma di fondi di investimento OICVM, sviluppata da SYZ Asset Management per soddisfare le esigenze di una base diversificata di clienti sia privati che professionali. OYSTER è una società di investimento di tipo aperto con una struttura a comparti multipli, costituita e regolamentata in Lussemburgo. Questa gamma di fondi fortemente orientata alla performance comprende quasi 30 prodotti che coprono un ampio ventaglio di classi di attivi, mercati e stili di investimento. Per soddisfare una base di clienti esperti ed esigenti, SYZ Asset Management affida la gestione degli attivi dei fondi OYSTER a specialisti degli investimenti interni ed esterni. Diverse strategie hanno consentito a determinati fondi di ricevere premi riconosciuti a livello internazionale. Attualmente i fondi OYSTER sono registrati per l'offerta al pubblico e/o distribuiti in diversi paesi tramite una capillare rete di distribuzione, ma non sono aperti ai cittadini o ai residenti degli Stati Uniti né a qualsiasi altra parte ritenuta una US person. Per informazioni sulla situazione distributiva di fondi OYSTER specifici e/o delle relative classi di azioni nel proprio paese di domicilio, si rimanda al sito www.syzassetmanagement.com.

INFORMAZIONE IMPORTANTE

Il contenuto del presente comunicato stampa è fornito a mero scopo informativo e non costituisce un invito né una raccomandazione alla vendita o all'acquisto. Investire nei fondi OYSTER comporta i rischi descritti nel Prospetto informativo. I dati sulla performance e altri dati a carattere informativo si basano su informazioni fornite dagli amministratori dei fondi o ottenute da fonti ritenute affidabili e attendibili. Pur ritenendoli corretti al momento della pubblicazione, SYZ Asset Management non ne garantisce la completezza, la puntualità o l'accuratezza. Qualora venga fornita la performance lorda, il dato non includerà, tra l'altro, le commissioni di gestione, di incentivo, amministrative, della banca depositaria e della società di revisione. Le performance passate non sono indicative delle performance future e il valore degli investimenti può diminuire o aumentare nel tempo. Prima di investire si raccomanda di rivolgersi a un consulente per gli investimenti indipendente, debitamente autorizzato e regolamentato. Il prospetto, il documento contenente le informazioni chiave per gli investitori e le relazioni annuali e semestrali più recenti possono essere consultati presso i rappresentanti locali o sul sito web www.syzassetmanagement.com.

Rappresentante in Svizzera: SYZ Asset Management (Suisse) SA, Rue François-Diday 6, 1204 Ginevra, Svizzera.
Agente incaricato dei pagamenti in Svizzera: Banque SYZ SA, Quai des Bergues 1, 1201 Ginevra, Svizzera

L'elenco completo dei rappresentanti locali con le relative informazioni di contatto è disponibile sul sito www.syzassetmanagement.com.