

07 Febbraio 2019

COMUNICATO STAMPA

GAM Systematic lancia una nuova strategia di credito dinamica

- Una strategia con approccio completamente sistematico, che mira a sovraperformare, in termini assoluti e aggiustati per il rischio, i mercati globali del credito nel corso del ciclo economico, cercando anche di mitigare il rischio nelle fasi di ribasso.
- Allocazione strategica sul credito, con l'abilità tattica di ridurre l'esposizione al rischio in condizioni di mercato sfidanti.
- Bassa correlazione a lungo termine con il credito tradizionale.
- Il quadro UCITS offre agli investitori una liquidità giornaliera.

GAM Investments ha annunciato il lancio di una nuova strategia di credito dinamica sulla sua piattaforma GAM Systematic, il cui patrimonio gestito in strategie quantitative ammonta a 4,3 miliardi di dollari al 30 novembre 2018.

L'innovativa strategia di credito è completamente sistematica, e mira a sovraperformare, in termini assoluti e adeguati al rischio, gli indici globali di riferimento del settore del credito durante un intero ciclo economico, riducendo il rischio nelle fasi di ribasso. La strategia assume posizioni lunghe sui mercati del credito e risponderà a mercati meno favorevoli riducendo l'esposizione al credito, o addirittura vendendolo allo scoperto, e assumendo posizioni lunghe nel reddito fisso come rifugio sicuro. La strategia è altamente liquida, negozia indici di credito, futures su titoli di Stato statunitensi ed europei e i titoli più liquidi all'interno di un universo tipicamente composto da circa 400 singoli titoli di credito.

La strategia combina dinamicamente tre approcci diversificati: credito tattico, credito direzionale e credito market neutral, che operano in modo simile, rispettivamente, ad un credit trader, credit strategist ed un credit analyst. La strategia mira a sovraperformare i mercati globali del credito nel corso del ciclo economico.

Gestita dal team di investimento di GAM Systematic, la strategia di credito dinamico integra la gamma esistente di strategie sistematiche già disponibili che comprende strategie azionarie, sul reddito fisso, multi-asset e alternative.

Alla base del processo di investimento di GAM Systematic c'è una robusta gestione del rischio, tutte le strategie sono rigorosamente e scientificamente testate prima di essere presentate agli investitori.

Anthony Lawler, co-responsabile di GAM Systematic, ha dichiarato: “Gli investitori sono sempre più alla ricerca di una diversificazione degli investimenti per i loro portafogli. La strategia di credito dinamico risponde a questa esigenza. Offre rendimenti creditizi, ma utilizza anche indicatori di crisi che puntano a ridurre il rischio di credito di portafoglio quando i mercati sono più sfidanti, diversificando così i rendimenti rispetto alle tradizionali allocazioni di credito.”

“La nuova strategia sul credito amplia l’offerta di GAM Systematic gestita in modo quantitativo fra le diverse asset class. Stiamo assistendo a un numero crescente di investitori che si dedicano a strategie sistematiche, e di recente le nostre due maggiori offerte – i premi di rischio alternativi e il nostro programma macroeconomico di base – hanno registrato afflussi netti positivi.”

Per maggiori informazioni vogliate contattare:

Ufficio Stampa
Verini & Associati
Marcella Verini, Micol Caffetto; Ranieri Stefanile
Tel.: +39 02 45395500
Email: mverini@verinieassociati.com; mcaffetto@verinieassociati.com;
rstefanile@verinieassociati.com

Visitate il nostro sito: www.gam.com
Seguiteci su: [Twitter](#) e [LinkedIn](#)

Note agli editori

La nuova strategia dinamica del credito mira ad ottimizzare i rendimenti di tre flussi diversificati, tra cui il credito tattico che tiene conto delle variazioni del sentiment di rischio del mercato, il credito direzionale che tiene conto dei cambiamenti ambientali nei mercati del credito e il credito neutrale al mercato che tiene conto delle variazioni degli spread relativi tra gli emittenti.

GAM in breve

GAM è una delle maggiori società mondiali indipendenti dedicate esclusivamente alla gestione patrimoniale. Offre soluzioni e fondi d’investimento a gestione attiva a clienti istituzionali, intermediari finanziari e investitori privati. Oltre all’attività nel settore degli investimenti, GAM offre servizi di “private labelling”, che comprendono dei servizi di supporto a gestori di terzi. GAM è presente sul mercato con oltre 900 dipendenti e uffici in 14 paesi. I suoi centri d’investimento si trovano a Londra, Cambridge, Zurigo, Hong Kong, New York, Lugano e Milano. I gestori sono supportati da un’ampia struttura sales su scala globale.

GAM, con sede centrale a Zurigo, è quotata al SIX Swiss Exchange ed è inclusa nello Swiss Market Index Mid (SMIM) con il simbolo «GAM». Il patrimonio gestito del Gruppo ammonta a CHF 139,1 miliardi (USD 139,2 miliardi)*.

* Fonte: GAM. Dati al 30 novembre 2018.

Importanti avvertenze legali

I dati esposti in questo documento hanno unicamente scopo informativo e non costituiscono una consulenza in materia di investimenti. Le opinioni e valutazioni contenute in questo documento possono cambiare e riflettono il punto di vista di GAM nell'attuale situazione congiunturale. Non si assume alcuna responsabilità in quanto all'esattezza e alla completezza dei dati. La performance passata non è un indicatore dell'andamento attuale o futuro.