

# INDICE

	<i>pag.</i>
<i>Presentazione</i> di <i>Marco Moretti</i>	3
<i>Prefazione</i> di <i>Luca Bagato e Alessio Gioia</i>	7

## Prima Parte

### LA STORIA DI LTCM

1. Introduzione	9
2. Origini di LTCM	11
3. Strategie di trading	14
4. Trade di convergenza	16
5. Trade di “relative value”	17
6. L’effetto leva	19
7. Ritorni	23
8. Rischio	26
9. Crollo	27
10. Rimborso	31
11. Cronologia degli eventi	33
12. Il tema del controllo del rischio in LTCM	33
13. I fondatori e i principali Partners di LTCM	35
14. Conclusioni	37

## Seconda Parte

### **Interviste simulate**

1. Gestione asset & liability	41
2. Gestione della liquidità	42
3. Errori nel risk management	42
4. Prospettive ed evoluzioni future della finanza	42
5. Interviste simulate e immaginate a ipotetici Partner di LTCM con l'utilizzo dell'Intelligenza Artificiale	43

### **Conclusioni**

1. Riassunto degli eventi del caso LTCM	91
2. Interviste simulate ai Partner di LTCM	92
3. Gestione asset & liability	92
4. Gestione della liquidità	93
5. Errori nel risk management	93
6. Prospettive ed Evoluzioni Future della Finanza	93
7. Riflessioni finali	94

<i>Bibliografia</i>	97
---------------------	----

<i>Gli Autori</i>	99
-------------------	----