Les fondamentaux de la gestion de portefeuille

Les techniques de gestions d'actifs, les OPCVM et la mesure de la performance

MIXTE

Pour qui

- Collaborateur de gestionnaire de portefeuille, collaborateur des back et middle offices, gestionnaire de patrimoine, juriste, informaticien, compliant officer.

Enjeu : Se perfectionner

Prérequis

- Connaître les mécanismes et le fonctionnement des marchés financiers ou avoir suivi la formation "Marchés financiers - Niveau 1" (réf. 7850).

Objectifs

- Maîtriser les fondamentaux de la gestion d'actifs.
- Intégrer les principes de la gestion de produits de taux.
- Appliquer les principes de la gestion actions.
- S'initier à la gestion structurée.
- Identifier les critères de mesure de la performance.

Programme

1/ Maîtriser l'environnement de la gestion d'actifs

- Les acteurs de la gestion d'actifs.
- Rôle et devoirs du gérant d'actifs.
- La classification AMF des OPCVM.

2/ Maîtriser l'arbitrage du couple rendement et risque

- Les différentes classes d'actifs.
- Rendement et risques des principales classes d'actifs.
- La notion de prime de risque.

3/ Réaliser la gestion des produits de taux

- Cartographie des produits de taux.
- La notion de taux actuariel.
- Les paramètres : sensibilité, duration, courbe des taux et risque crédit.
- Décrypter la fiche d'information d'un OPCVM obligataire.

4/ S'initier à la gestion structurée

- Objectifs d'une gestion structurée.
- Mettre en place une garantie.
- typologie de gestion structurée et analyse du couple rendement risque.

5/ Gérer un portefeuille d'actions

- La gestion indicielle : notion de tracking error et efficience des marchés.
- La gestion active :
  - approches bottom up ou top down ;
  - value ou growth ;
  - rotation sectorielle et cycle de marché.
- La typologie des hedge funds.

6/ Évaluer la performance de la gestion d'un portefeuille

- Les mesures de la performance : MWreturn et TWreturn.
- Les mesures de la performance ajustées du risque : ratios Sharpe, d'information et de Treynor et Calmar.
- Les normes GIPS.
- Analyse de rapports de gestion d'OPCVM.

7/ Activité à distance

- Pour s'approprier les apports d'un expert sur un point théorique ou pratique : un **@expert** "Découvrir les principes de la gestion structurée".

Points forts / Moyens pédagogiques

- Une pédagogie active s'appuyant sur des cas pratiques de gestion d'un portefeuille d'actions et d'un portefeuille d'obligations.
- Mise en œuvre immédiate des concepts de la formation par l'analyse de documents d'information et de rapports de gestion d'OPCVM.
- Une formation animée par des gérants de portefeuille.

2 jours (14h présentiel) **+ activités à distance** (en complément)

Réf. 7852

38 €HT Paris

1 395 €HT

Dates et villes

Sur cegos.fr, retrouvez en temps réel les dates et les places disponibles en tapant la Réf. 7852

Formation proposée à Paris

Partenaire

DII DRIVE INNOVATION INSIGHTS

Dans le cadre de notre démarche qualité, toutes nos formations font l'objet d'une évaluation détaillée par les participants : « à J+1 » dès le lendemain de la fin de la formation.
Sanction de la formation : attestation de formation.

© Cegos 2018

Sessions en 2018 - Référence 7852

Paris

Qualité des formations :
Cegos est certifié AFAQ selon le référentiel ISO 9001, qualifié OPQF (qualification figurant sur la liste CNEFOP) et enregistré au Datadock.

Retrouvez en temps réel les dates et les places disponibles sur Cegos.fr en tapant la référence 7852
Toutes nos formations sont réalisables dans votre entreprise à la date qui vous convient.
Document créé le 01/07/2019