

Les fondamentaux de la gestion de portefeuille



DB-4 2 Jours (14 Heures)

Description

En partenariat avec Drive Innovation Insights Cette formation est destinée à toute personne qui évolue dans les métiers de la gestion d'actifs ou qui est en relation avec les acteurs de la gestion d'actifs sans être des financiers : collaborateur de services de courtage, de fonds d'investissement, de sociétés de gestion de placements, de compagnies d'assurance ; consultant en organisation, juriste, fiscaliste... Elle vous permettra de vous approprier l'organisation des sociétés de gestion, les concepts clés et les principaux mécanismes de gestion d'un portefeuille d'actifs financiers. L'objectif est également de vous permettre de maîtriser les techniques de mesure de la performance et ainsi décrypter les documents d'information et les reportings publiés par les gestionnaires d'OPC.

À qui s'adresse cette formation ?

Pour qui

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

Prérequis

Aucune

Les objectifs de la formation

- 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 de la formation

Maîtriser l'environnement de la gestion d'actifs

- Les acteurs de la gestion d'actifs.
- Rôle et devoirs du gérant d'actifs.

Connaitre le fonctionnement des sociétés de gestion et des OPC

- Organisation des sociétés de gestion.
- Les réglementations applicables: UCITS, AIFM, agréments AMF.
- Mesure de la performance des OPC et classification.

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.
- La fiche d'information d'un OPC obligataire.

S'initier à la gestion structurée Objectifs d'une gestion structurée.

- Mettre en place une garantie.
- Typologie de gestion structurée.

Gérer un portefeuille d'actions La gestion indicielle.

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

Évaluer la performance de la gestion d'un portefeuille Analyse du couple rendement risque.

- 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'OPC.

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'.