

Les fondamentaux de la gestion de portefeuille

-Référence: **DB-4**

-Durée: **2 Jours (14 Heures)**

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.

A 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.

Programme

- **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'.



(+212) 5 22 27 99 01



(+212) 6 60 10 42 56



Contact@skills-group.com

Nous sommes à votre disposition :
De Lun - Ven 09h00-18h00 et Sam 09H00 – 13H00

Angle bd Abdelmoumen et rue Soumaya, Résidence Shehrazade 3, 7ème étage N° 30
Casablanca 20340, Maroc