

## PUBLIC

Collaborateurs et managers de fonctions commerciale et distribution en asset management

## PRÉ-REQUIS

Une expérience pratique sur le sujet est recommandée

## NIVEAU D'EXPERTISE

Perfectionnement

## MOYENS PÉDAGOGIQUES

- Dispositif de formation structuré autour du transfert des compétences
- Acquisition des compétences opérationnelles par la pratique et l'expérimentation
- Apprentissage collaboratif lors des moments synchrones
- Parcours d'apprentissage en plusieurs temps pour permettre engagement, apprentissage et transfert
- Formation favorisant l'engagement du participant pour un meilleur ancrage des enseignements

## SATISFACTION ET EVALUATION

- L'évaluation des compétences sera réalisée tout au long de la formation par le participant lui-même (auto-évaluation) et/ou le formateur selon les modalités de la formation.
- Evaluation de l'action de formation en ligne sur votre espace participant :
  - ▶ A chaud, dès la fin de la formation, pour mesurer votre satisfaction et votre perception de l'évolution de vos compétences par rapport aux objectifs de la formation. Avec votre accord, votre note globale et vos verbatims seront publiés sur notre site au travers d'avis Vérifiés, solution Certifiée NF Service
  - ▶ A froid, 60 jours après la formation pour valider le transfert de vos acquis en situation de travail

Code  
**1584**

Durée  
**Sur-mesure / 7 heures**

Tarif  
**Nous contacter**

*\*Repas inclus (en présentiel)*

## Objectifs pédagogiques

- Mettre à jour l'univers des primes de risques alternatives
- Expliquer la logique économique pour chaque prime

## Programme de la formation

### Primes académiques vs primes de trading

- Facteurs de risque et primes de risques académiques
- Implémentation des ARPs : de la théorie à la pratique
- La frontière entre primes académiques et primes de trading
- ARP, factor investing et hedge funds
- Exercices d'application

### Les primes issues de la recherche académique

- La prime Momentum (Equities, FX, commodities)
- La prime Value (FX, commodities)
- La prime Carry (FX, commodities)
- La prime Low risk (Equities, rates, credit, FX, commodities)
- Exercices d'application

### Les primes issues des activités de trading

- La prime Trend following (Equities, rates, credit, FX, commodities)
- La prime Mean Reversion (Equities, rates, credit, FX, commodities)
- La prime Short Volatility (Equities, rates, credit, FX, commodities)
- La prime Volatility carry
- Exercices d'application

### Risque, rendement et diversification entre primes de risque

- Les primes de risques évaluées dans un monde moyenne-variance
- Les limites des modèles classiques : non normalité et prise en compte des rendements extrêmes
- Comment mesurer la diversification ?
- Peut-on timer les primes de risque ?

- Suivi des présences et remise d'une attestation individuelle de formation ou d'un certificat de réalisation

