

Techniques de gestion en approche top-down

Procéder à une allocation d'actifs pour l'optimisation du capital

PUBLIC

Département analyse Action –
Equipes commerciales Sociétés de
gestion/Asset Managers, Banques
privées, intermédiaires financiers –
Gérants sous mandat – CIF – CGP –
Family office – Banques de réseau,
clientèle ++ – Banques à distance –
Fonction IT – Consultants SSII
Banque-Assurance

PRÉ-REQUIS

Une expérience pratique de gestion
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

Code
700156

Durée
**Sur-mesure / 14
heures**

Tarif
Nous contacter

**Repas inclus (en présentiel)*

Objectifs pédagogiques

- Situer l'environnement conjoncturel dans un cycle de moyen long terme
- Identifier les différents cycles de performance par style de gestion
- Mesurer la sensibilité d'un portefeuille pour mieux le couvrir

Programme de la formation

Les supports d'investissement cash et dérivés

Les acteurs de la gestion collective

- Investisseurs
- Organismes de tutelle
- Sociétés de gestion

Notions fondamentales

- L'alpha et le bêta
- Le couple rendement / risque
- Les modèles : CAPM, APT et Markowitz
- TP Excel : exercices de mise en pratique

Les étapes du processus de gestion

- Analyses
 - ▶ analyse macro économique
 - ▶ analyse financière et analyse crédit
 - ▶ market timing
 - ▶ analyse quantitative
- Allocation d'actifs
 - ▶ décision d'investissement
 - ▶ application des techniques et modèles de gestion
 - ▶ intervention sur les marchés
 - ▶ mesure et gestion des risques au quotidien
- TP Excel : exercice d'allocation d'actifs selon plusieurs scénarii

Les différentes gestions en pratique

- Indicielles et tiltées
- Growth / value, stock picking et core-satellite
- Se retrouver parmi les différents types d'OPC

Couverture de portefeuille

- Sensibilités et principes de couverture
- TP Excel : couverture par Futures et stratégies optionnelles

La multigestion en pratique

Vérifiés, solution Certifiée NF Service

- ▶ A froid, 60 jours après la formation pour valider le transfert de vos acquis en situation de travail
- Suivi des présences et remise d'une attestation individuelle de formation ou d'un certificat de réalisation

Approche de la gestion alternative

- Les objectifs et les outils
- Les principales stratégies

Mesure et attribution des performances

- Calculs de performance
- Mesure GIPS
- Les VaR et l'évaluation du risque

Parmi nos formateurs



Anthony Cros

Anthony a travaillé en tant qu'analyste action chez Barclays à Londres. Il est aujourd'hui gérant indépendant. Cette double expertise lui permet de vous faire profiter d'un point de vue global sur les techniques de gestion et d'intervention sur les marchés financiers.