

Gestion d'actifs : gestion alternative et Hedge Funds

Programme

1. Introduction

- Gestions alternatives
- Histoire des hedge funds
- Taille de l'industrie
- Acteurs identifiés
- Répartition géographique
- LTCM ou Soros Quantum
- De l'artisanat à l'industrie

2. Les hedge funds

- Gestion traditionnelle vs hedge funds
- Localisation des équipes
- Domiciliation des fonds
- Instruments financiers utilisés
- Organisation d'un hedge fund
- Rôle du Prime Broker
- Réglementation AIFM
- Classifications et stratégies
- Indices hedge funds

Travaux pratiques :

- *Stratégie directionnelle ou non*

3. Les stratégies pas à pas

- Event driven
- Macro / CTA / Managed Futures
- Directionnel actions
- Relative value
- Fonds de fonds
- Rentabilité/risque et corrélations
- Comment investir dans un hedge fund ?

Travaux pratiques :

- *Tableau de comparaison des stratégies*
- *Analyse d'un reporting par stratégie*

4. Due diligence / Analyse

- Les points clés de l'analyse
- Le questionnaire AIMA
- Analyse critique de la performance

Travaux pratiques :

- *Examen d'un questionnaire AIMA*
- *Examen d'un formulaire ADV*

Durée : 1 jour (7 heures)

Tarif : 990 € HT

Option cours garanti : + 290 € HT *

Dates :

- **18 mai 2021**

- **14 octobre 2021**

- **16 décembre 2021**

Objectifs :

- Appréhender la gestion alternative notamment celle des hedge funds
- Connaître et maîtriser le vocabulaire propre aux hedge funds
- Acquérir les outils d'analyse d'un fonds d'investissement alternatif
- Savoir investir dans un hedge fund
- Illustrer chaque point par des exemples concrets

Public visé /Métiers ou fonctions concerné(e)s par cette formation :

Tous publics souhaitant avoir une compréhension de la gestion alternative notamment hedge fund

Prérequis :

Premières connaissances de la gestion d'actifs et des instruments financiers ou module 1 – L'essentiel de la gestion d'actifs

Moyens et méthodes pédagogiques :

Alternance de cours et d'études de cas

Modalité d'évaluation :

Questionnaire préalable
QCM de fin de session

Validation :

Attestation de suivi de formation

Animateur pressenti :

Fabien Arcambourque, diplômé du CIIA, est Agent général d'assurance, et compte 15 ans d'expérience en finance de marché et conseil en gestion d'actifs auprès d'institutionnels. Il a co-fondé une plateforme institutionnelle d'investissements et de gestions délégués.