

La gestion de fonds et la sélection de fonds (multigestion)

Programme

1. Pourquoi la multigestion ?

- L'offre de services
- Inconvénients
- Multigestion ou conseil ?

2. Les types de multigestion

- Généraliste - Spécialiste

3. Les résultats

- Analyse historique de l'apport de la multigestion, et comparaison avec la gestion diversifiée

4. Les acteurs

- Les fournisseurs de multigestion (multi gérants et sélectionneurs de fonds)
- Les utilisateurs de multigestion (investisseurs)

5. Sélection des classes d'actifs

- Markovitz et la théorie moderne du portefeuille
- Allocation d'actifs stratégique
- Allocation d'actifs tactique

6. Sélection des stratégies de gestion

- Les stratégies de gestion
- Les styles de gestion
- Les outils de gestion
- Sélection quantitative - Exercice
- Sélection qualitative

7. Sélection des gérants

- Objectif ultime d'une bonne sélection de gérant
- Sélection quantitative - Exercice
- Attribution de performance - Exercice
- Sélection qualitative - Exercice

8. Construction de portefeuille

- Objectifs de la gestion de portefeuille
- Différentes méthodes de construction de portefeuille
- Exercice

9. Gestion des risques

- Choisir de prendre quels risques pour quel rendement ?
- Risques propres aux stratégies de gestion
- Risques propres aux gérants
- Risques de marché : mesure et évaluation qualitative
- Risques opérationnels

10. Contrôle des risques

- Définition de la gestion des risques
- Organisation
- Les alertes

11. Défis de la multigestion

- Transparence

Durée : 2 jours (14 heures)

Tarif : 1 980 € HT

Option cours garanti : + 580 € HT *

Dates :

- 5 et 6 avril 2021

- 2 et 3 juin 2021

- 6 et 7 septembre 2021

Objectifs :

- Maîtriser les fondamentaux de la sélection de fonds
- Définir une stratégie de gestion
- Apprendre à construire un portefeuille
- Gérer les risques

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

Analyste financier, gérant de fonds, trésorier d'entreprise, opérateur middle office, auditeur

Prérequis :

Une bonne culture générale financière

Moyens et méthodes pédagogiques :

Questions-réponses, exercices (Quiz et Excel), jeux de rôles

Modalité d'évaluation :

Questionnaire préalable

QCM de fin de session

Validation :

Attestation de suivi de formation

Animateur pressenti :

Christophe Chouard a fondé sa société de Conseil en Investissement Financier après une expérience de 17 ans en Banque d'Investissement (JP Morgan et Crédit Agricole) et 6 ans en gestion d'actifs. Par ailleurs, il est formateur au CIIA et membre de la SFAF depuis 2011. Il intervient également dans les domaines de la finance et de l'économie au sein de plusieurs universités et au CNAM.