

## Construction d'un portefeuille

Cours - Standard

Ref	Dates	Jours	Heures	Durée	Financement	CHF
326751	Mai 2024		18:15 - 21:15			CHF 775

### DÉFINITION

La construction d'un portefeuille est la première étape du processus de gestion de portefeuille. Elle doit se faire en adéquation avec le profil de risque du client et en tenant compte des caractéristiques des différentes classes d'actifs et du contexte économique et financier.

Ce cours vise à développer chez l'élève une méthodologie, un corpus de connaissances théoriques et d'applications pratiques qui lui seront utiles dans la réalité du métier de gérant de fortune / portfolio manager.

### PRÉREQUIS

Afin de pouvoir participer à ce cours vous devez avoir suivi le cours Introduction à la stratégie d'investissement et l'allocation d'actifs; les candidats possèdent des notions bancaires et/ou ont suivi le cours "introduction aux marchés et produits financiers".

### INSCRIPTION

Dans un objectif d'accessibilité, la formation se déroule en format hybride (« blended »), une partie des cours étant dispensée en synchrone (en présentiel) et l'autre partie en asynchrone (à distance), via la plateforme d'apprentissage en ligne Smartacademy (Learning Management System).

Cette méthode d'enseignement flexible offre aux participants la possibilité de progresser à leur rythme et d'approfondir certains sujets.

### PUBLIC

Ce cours s'adresse à toute personne évoluant déjà dans le domaine financière et aspirant à se perfectionner dans la gestion de portefeuille.

### EVALUATION ET TITRE DÉCERNÉ

Oral : 10 minutes par candidat-e : présentation du portefeuille au client (jeux de rôle) ; avec certificat de réussite (note minimum de 4 sur 6).

### OBJECTIFS

Ce cours permet d'acquérir les bases des connaissances afin d'être en mesure de construire un portefeuille, de le suivre ainsi que de l'ajuster.

- Mettre en application l'acquis de la formation :
- Etre en mesure de construire un portefeuille, de le suivre ainsi que de l'ajuster.
- Maîtriser les bases des mathématiques financières qui sont indispensables à la gestion de portefeuille
- Utiliser et être à l'aise avec le logiciel Excel pour effectuer des calculs

### CONTENU

- Les différentes étapes de la construction d'un portefeuille à partir d'un profil du client et une grille d'allocation actifs.
- Le principe de la diversification et la notion de volatilité
- Le risque de change
- Elaborer une grille tactique de portefeuille
- Les étapes de la gestion du portefeuille
- Identification du profil du client
- Allocation des actifs
- Suivre le portefeuille
- Calcul de la performance
- Evaluation du portefeuille
- Présenter et commenter le portefeuille.

## Méthode

- Cours interactifs et sur Internet
- Jeux de rôle
- Exercices pratiques
- Travaux de groupe et cas pratiques

## Matériel

- Support de cours de l'enseignante
- Presse financière

## INTERVENANTS

Michel Auch travaille dans le secteur bancaire depuis plus de 40 ans. Tour à tour analyste sur actions, gérant de fonds de placement puis responsable clientèle pour une banque Private Banking, il a également eu l'occasion de parfaire ses connaissances lors de séjours à l'étranger (Australie, Allemagne, USA) et lors d'études qui l'ont mené à l'obtention du diplôme d'analyste financier et gestionnaire de fortune (CIIA). Fort de ces différentes expériences, il s'est spécialisé dans la gestion de portefeuille ces dix dernières années et collabore avec l'!fage pour la cinquième année.

## DURÉE ET ORGANISATION

- Cours en synchrone (en présentiel):
  - Selon planning, mardi ou jeudi à partir de 18h15 en formation du soir, soit une à deux soirées par semaine de 3 à 4 périodes de 45 minutes (examen écrit une à deux périodes)
  - Certains cours peuvent avoir lieu par visioconférence, via Zoom, veuillez consulter l'horaire détaillé pour plus d'information ou contacter le gestionnaire de cours
- Cours en asynchrone (sur smartacademy) :
  - Selon planning, en toute indépendance selon la disponibilité du participant, entre 2 et 4 périodes par semaine

## PROCHAINE RENTRÉE

Mai 2024

## REMARQUES

-

## CONTACT

E : olivier.christen@ifage.ch

T : +41 (0)22 807 3083