

Cycle Marchés Financiers : produits, méthodes de gestion et évaluation du portefeuille

Lien : https://maroc-performance.com/formation/cycle-marches-financiers-produits-methodes-de-gestion-et-evaluation-du-portefeuille

DURÉE
10 jours (70h)

RÉFÉRENCE
FNC246

CATÉGORIE
Finance de Marché

Maroc Performance

🎯 OBJECTIFS DE LA FORMATION

À l'issue de cette formation, vous serez capable de :

- ✔ Acquérir une compréhension complète des marchés financiers et de leurs instruments
- ✔ Identifier et évaluer les différents types de produits financiers
- ✔ Maîtriser les méthodes d’analyse fondamentale et technique
- ✔ Appliquer les théories modernes de gestion de portefeuille
- ✔ Concevoir une stratégie d’investissement adaptée à un profil de risque
- ✔ Savoir mesurer et gérer les différents types de risques
- ✔ Utiliser les produits dérivés pour optimiser ou sécuriser les portefeuilles
- ✔ Intégrer les principes de l’investissement responsable et ESG
- ✔ Utiliser des outils professionnels de modélisation et de simulation
- ✔ Être capable de structurer un portefeuille diversifié et optimisé
- ✔ Connaître les règlementations et contraintes liées à la gestion d’actifs
- ✔ Analyser les performances passées et réajuster les stratégies
- ✔ Préparer à la certification ou à la spécialisation en finance de marché
- ✔ Développer une autonomie décisionnelle sur les marchés financiers

👥 POUR QUI ?

- ✔ Analystes financiers souhaitant renforcer leur maîtrise des marchés
- ✔ Gérants de portefeuille et professionnels de l’investissement
- ✔ Chargés d’études financières ou économiques dans les institutions
- ✔ Auditeurs internes ou contrôleurs de gestion du secteur financier
- ✔ Professionnels de la banque et de l’assurance
- ✔ Conseillers en gestion de patrimoine ou indépendants
- ✔ Actuaires, experts en risques ou compliance officers
- ✔ Cadres d’organismes de régulation ou de supervision

Maroc Performance



Programme détaillé

1 / Introduction aux marchés financiers

- Présentation des marchés primaires et secondaires
- Rôle économique et acteurs des marchés financiers
- Typologie des produits financiers

2 / Typologie des produits financiers

- Produits de taux, actions et obligations
- Produits dérivés : options, futures, swaps
- Produits structurés et hybrides

3 / Fonctionnement des marchés

- Modalités de cotation et d'exécution
- Marché réglementé, OTC et plateformes alternatives
- Liquidité, volatilité et efficience

4 / Analyse fondamentale

- Étude des états financiers des entreprises
- Ratios financiers clés et valorisation
- Analyse sectorielle et macroéconomique

5 / Analyse technique

Maroc Performance

- Théorie de Dow et lecture des graphiques
- Indicateurs techniques : RSI, MACD, moyennes mobiles
- Figures chartistes et signaux d’achat/vente

6 / Théorie moderne du portefeuille

- Diversification et frontière efficiente
- Modèle de Markowitz
- Optimisation du couple rendement/risque

7 / Gestion active et gestion passive

- Stratégies d’allocation dynamique
- Suivi d’indice et ETF
- Choix entre gestion discrétionnaire et quantitative

8 / Modèles d’évaluation des actifs

- CAPM (Capital Asset Pricing Model)
- Modèle d’Arbitrage (APT)
- Modèles multifactoriels

9 / Mesure et gestion du risque

- VaR, CVaR, bêta et tracking error
- Risques de marché, de crédit et de liquidité
- Stress tests et scénarios extrêmes

10 / Produits dérivés et couverture

- Utilisation des dérivés pour couvrir un portefeuille
- Stratégies de couverture : collars, spreads, swaps
- Notions de delta, gamma, vega, theta

Maroc Performance

11 / Allocation d’actifs

- Allocation stratégique, tactique et dynamique
- Méthodologie d’allocation par classes d’actifs
- Gestion multi-actifs et corrélation

12 / Construction et suivi d’un portefeuille

- Définition du profil investisseur
- Sélection des titres et rééquilibrage
- Reporting et évaluation de la performance

13 / ESG et investissement responsable

- Intégration des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance
- Labels ISR, obligations vertes et impact investing
- Risques de greenwashing et analyse extra-financière

14 / Études de cas et simulations

- Simulation de portefeuille en environnement réel
- Étude de performances passées et optimisation
- Prise de décision sur plateforme de trading simulée
- Analystes financiers souhaitant renforcer leur maîtrise des marchés
- Gérants de portefeuille et professionnels de l’investissement
- Chargés d’études financières ou économiques dans les institutions
- Auditeurs internes ou contrôleurs de gestion du secteur financier
- Professionnels de la banque et de l’assurance
- Conseillers en gestion de patrimoine ou indépendants
- Actuaires, experts en risques ou compliance officers
- Cadres d’organismes de régulation ou de supervision

Maroc Performance

Approche pédagogique

- Support Ecrit et Projection
- Exposés Interactifs, Podcasts et Vidéos
- Brainstorming et Jeux de Rôle
- Mises en Situation pour faciliter l'assimilation
- Cas Pratiques et Labs inclus pour leur impact opérationnel
- Test de Validation des Acquis des Connaissances

Prochaines dates programmées

15 au 26 Fév. 2027	Présentiel - Casablanca
12 au 23 Avr. 2027	Présentiel - Casablanca
07 au 18 Juin 2027	Présentiel - Casablanca
02 au 13 Août 2027	Présentiel - Casablanca
27 Sep. au 08 Oct. 2027	Présentiel - Casablanca

Autres dates possibles sur demande. Contactez-nous pour organiser une session intra-entreprise.

Réservation & Renseignements

Téléphone : +212 522 247 210
Email : contact@maroc-performance.com
Web : https//www.maroc-performance.com

Maroc Performance — Tous droits réservés