BANQUE - ASSURANCE

Gestion active de portefeuille : construire, arbitrer et mesurer la performance

La gestion active est contestée par la concurrence des fonds indiciels et par des investisseurs qui demandent des comptes sur les frais prélevés. Le gérant doit démontrer que ses écarts par rapport à l'indice de référence procèdent d'un processus assumé. Les reportings restent pourtant descriptifs et peinent à isoler les sources réelles de performance. Ces deux jours outillent la conduite d'une gestion active. Vous travaillez la construction de portefeuille et le suivi du risque relatif puis l'attribution de performance qui permet d'expliquer un écart à un comité ou à un client institutionnel.

DURÉE	MODALITÉ	TARIF	DÉLAI D'ACCÈS
2 jours — 14 h	**Présentiel ou à distance**	**À partir de 1 880 € HT**	**11 jours ouvrés après validation du financement.**

Mon Pôle Formation est un organisme certifié Qualiopi. La certification qualité a été délivrée au titre de la catégorie d'action suivante : **ACTIONS DE FORMATION** — certificat n° 76 31 02622 31 (SGS ICS)

01 Public visé et prérequis

PUBLIC VISÉ
Gérants de portefeuille et analystes financiers ainsi que gestionnaires sous mandat et collaborateurs des fonctions risque et reporting.

PRÉREQUIS
Connaître les principaux instruments financiers et le vocabulaire de la gestion d'actifs.

POSITIONNEMENT À L'ENTRÉE
Analyse du besoin et test de positionnement. Vos réponses sont partagées avec votre formateur afin d'adapter la formation à votre niveau et votre contexte professionnel.

02 Objectifs pédagogiques

À l'issue de la formation, le participant sera capable de :

- Formaliser un processus d'investissement et ses règles de décision
- Construire un portefeuille en cohérence avec un indice de référence
- Mesurer le risque relatif et les contributions au risque du portefeuille
- Réaliser une attribution de performance et en tirer un commentaire de gestion
- Expliquer ses choix de gestion devant un comité d'investissement

03 Programme détaillé

M1 Fondements de la gestion active

- Ce que l'on cherche à battre
- Sources d'inefficience des marchés et limites
- Choix d'un indice de référence et univers d'investissement
- Gestion active face à la gestion indicielle
- Contraintes de mandat et budget de risque
- À retenir : Une gestion active se juge sur l'écart assumé à son indice de référence et non sur la performance brute.

M2 Processus d'investissement

- De la conviction à la ligne en portefeuille
- Analyse descendante et analyse ascendante
- Construction des convictions et dimensionnement des positions
- Règles d'entrée et de sortie
- Traçabilité des décisions de gestion
- Atelier : Les participants formalisent le processus d'investissement d'une stratégie de leur choix.

M3 Risque relatif et construction de portefeuille

- Tenir l'écart sous contrôle
- Écart de suivi et risque actif
- Diversification et concentration des paris de gestion
- Contraintes réglementaires et limites internes
- Suivi des expositions sectorielles et géographiques
- Cas pratique : Le groupe ajuste un portefeuille dont l'écart de suivi dépasse la limite du mandat.

M4 Mesure et explication de la performance

- Rendre compte de sa gestion
- Indicateurs de performance ajustée du risque
- Attribution de performance par allocation et par sélection
- Effet des frais sur la performance nette
- Rédaction du commentaire de gestion
- Mise en situation : Chaque participant présente l'explication de sa performance à un comité joué par le groupe.

04 Modalités pédagogiques, méthodes et moyens

MODALITÉS PÉDAGOGIQUES
Présentiel ou à distance

LIEU / FORMAT
Dans vos locaux — jusqu'à 10 collaborateurs, Paris — Présentiel, À distance — Classe virtuelle

MÉTHODES MOBILISÉES
• Apports théoriques, ateliers et cas pratiques. Support de cours numérique et fiches méthodes fournis.

ENCADREMENT
Formateurs qualifiés et expérimentés, experts de leur domaine, sélectionnés par Mon Pôle Formation.

05 Modalités d'évaluation et de suivi

ÉVALUATION DES ACQUIS
• QCM et mises en situation. Évaluation des acquis en début et en fin de parcours, évaluation à chaud et à froid à 60 jours.

SUIVI DE L'EXÉCUTION
• Émargement des participants
• Certificat de réalisation remis à l'issue de la formation

SANCTION DE LA FORMATION
Attestation de fin de formation et certificat de réalisation remis à chaque participant.

06 Type de reconnaissance

Formation non certifiante — Attestation de fin de formation et certificat de réalisation remis à chaque participant.

07 Modalités d'accès, financement et tarifs

MODALITÉS D'INSCRIPTION
Inscription en ligne, par téléphone, par devis ou via votre OPCO.

DÉLAI D'ACCÈS
11 jours ouvrés après validation du financement.

FINANCEMENTS POSSIBLES
- OPCO et plan de développement des compétences
- FAF et CFP
- France Travail
- Paiement jusqu'à 6 fois sans frais

DATES / SESSIONS
Entrées permanentes

FORMULE	DÉTAIL	TARIF
Inter-entreprises	-10 % dès 2 participants, -15 % dès 3, -20 % à partir de 4 inscrits sur la même session.	**À partir de 1 880 € HT**

Prix nets — exonération de TVA, article 261-4-4° du CGI.

08 Accessibilité aux personnes en situation de handicap

Accessible aux personnes en situation de handicap. Contactez notre référent handicap pour construire une solution adaptée : contact@monpoleformation.fr

RÉFÉRENT HANDICAP
Tiffany LESTROUBAC

CONTACT
contact@monpoleformation.fr

09 Indicateurs de résultats

INDICATEUR	RÉSULTAT	MODALITÉS DE CALCUL
Taux de satisfaction	**N/A**	Moyenne des notes de satisfaction des stagiaires sur les 12 derniers mois
Taux d'abandon	**N/A**	Calculé sur les 12 derniers mois

Résultats arrêtés au 29/09/2026. N/A : donnée non disponible ou effectif insuffisant sur la période.

10 Contacts

INSCRIPTIONS ET INFORMATIONS
contact@monpoleformation.fr
01 87 66 57 66

ADRESSE
10a rue du Maréchal de Lattre de Tassigny, 76420 Bihorel

RÉCLAMATIONS
Par e-mail : contact@monpoleformation.fr