



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

🎯 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 réglementations 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



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

- 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

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

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

 02 au 13 Nov. 2026

 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>