

**SESSION
GRATUITE***

*Offre gratuite limitée à une place par entreprise et réservée aux prospects et clients directs d'AMINDIS

 **AMINDIS**
ACADEMY



*Formation spécialisée
en gestion d'actifs*

Performance, risque, ratios

Maîtrisez les calculs de performance et la mesure du risque

Infos pratiques

Dates : 14, 15 et 16 avril (3 jours)

Lieu : centre Dolfi formation, Paris

Format : inter-entreprise, en présentiel

Langue : français

Horaire : 09h00 - 17h30

Formateur : **Philippe Grégoire, PhD**, responsable de la R&D financière chez AMINDIS. Professeur à la Louvain School of Management, reconnu dans le monde académique pour avoir publié de nombreux articles, se fera un plaisir de vous donner cette formation.

Objectifs

Dans cette **formation intensive de trois jours**, vous acquerez une expertise solide dans les calculs des returns, de performance et les mesures de risque. Vous étudiez des méthodologies robustes et rigoureuses, combinant théorie et pratique à travers des exercices concrets réalisés sur Excel. Une analyse approfondie des résultats sera effectuée en explorant des études de cas.

La formation approfondira aussi les trois principales catégories de risques : total, systématique et spécifique. En mettant l'accent sur l'utilisation et l'interprétation des ratios, la formation offre également une opportunité unique de maîtriser les principes fondamentaux et les indicateurs financiers les plus pertinents.

A qui s'adresse la formation ?

- Analystes performance
- Responsables du reporting
- Gestionnaires de risques
- Responsables Request For Proposal (RFP)
- Responsables Request For Information (RFI)
- Responsables relations client
- Responsables performance
- Responsables financiers
- Cadres financiers et de gestion
- Conseillers en investissements financiers
- Contrôle et responsables de la conformité
- Middle office
- Toute personne intéressée par la maîtrise ou par une meilleure compréhension de la mesure de performance et du risque.

Connaissances requises

Les prérequis pour profiter pleinement de cette formation comprennent :

- **Compréhension** de base des **concepts financiers**
- **Familiarité** avec la **gestion des investissements**
- **Expérience** professionnelle dans des **domaines** liés à la **finance**

Bien que ces prérequis ne soient pas strictement nécessaires, ils aident les participants à mieux comprendre et à tirer le meilleur parti de la formation. Les participants sans expérience préalable dans le domaine financier peuvent également bénéficier de la formation, mais ils pourraient avoir besoin de consacrer plus de temps à la compréhension des concepts fondamentaux.

**Pour rester informé de toutes les nouveautés
AMINDIS Academy, rendez-vous sur notre site !**



www.amindis.com/amindis-academy

Programme

Performance

- Rendements arithmétiques, géométriques et logarithmiques
- Rendement en devise locale, rendement en devise de portefeuille et rendement des stratégies de couverture
- Money weighted return, time weighted return et taux de rendement interne
- Traitement des apports/retraits, début de journée, fin de journée, Dietz et Dietz modifié
- Holding vs transaction based return
- Contribution au rendement et chaînage des contributions
- Rendements des produits dérivés et des sous-portefeuilles utilisant des produits dérivés
- Rendements des benchmark, rebalancement et couverture des devises
- Rendements des fonds, VNI nette, VNI brute et TER

Risque (ex-post)

- Identification et mesure des différentes sources de risque
- Écart-type (volatilité)
- Risque spécifique et systématique
- Downside risk
- Perte maximale cumulée (Maximum Drawdown) et recovery period
- Value at Risk (VaR)
- Conditional Value at Risk (CVaR) ou perte attendue
- Tracking error

Ratios

Comparaison avec un univers

Risque total :

- Ratio de Sharpe
- Ratio de Sortino

Risques spécifiques :

- Appraisal ratio
- Ratio d'information

Risques systématiques :

- Alpha de Jensen
- Ratio de Treynor
- Modigliani M²

Résumé et interprétation

Supports et moyens pédagogiques

- Documentation en PowerPoint
- Exemples
- Illustrations
- Exercices pratiques sous Excel

Je m'inscris >



Contact

Sophie Tahir

Marketing Manager

Email : stahir@amindis.com

Phone : +32 10 23 86 43



Einstein Business Center

Rue du bosquet 15A
1348 Louvain-la-Neuve
Belgique

Découvrez
ce que **nos participants précédents**
ont à dire sur **leur expérience** avec **AMINDIS Academy** :



Je recommande vivement cette formation pour acquérir une compréhension approfondie des concepts de performance et de risque. Les exercices pratiques étaient particulièrement bénéfiques pour consolider la théorie et la mettre en application.

Performance Management and Reporting Officer,
Banque Degroof Petercam



C'était une formation très enrichissante. Elle m'a permis d'acquérir des connaissances approfondies, et une meilleure capacité d'interpréter et de remettre en question les rapports de gestion d'actifs.

Anneleen Jolling, Internal Auditor,
DKV/Ergo