

Intégrer les ETF dans sa gestion de portefeuille

## PUBLIC

Gérants - Risks managers -  
Structureurs - Middle office -  
Collaborateurs et managers des  
fonctions de contrôle interne

## PRÉ-REQUIS

Avoir une expérience pratique sur le  
sujet

## NIVEAU D'EXPERTISE

Perfectionnement

## MOYENS PÉDAGOGIQUES

- Dispositif de formation structuré  
autour du transfert des  
compétences
- Acquisition des compétences  
opérationnelles par la pratique et  
l'expérimentation
- Apprentissage collaboratif lors des  
moments synchrones
- Parcours d'apprentissage en  
plusieurs temps pour permettre  
engagement, apprentissage et  
transfert
- Formation favorisant  
l'engagement du participant pour  
un meilleur ancrage des  
enseignements

## SATISFACTION ET EVALUATION

- L'évaluation des compétences  
sera réalisée tout au long de la  
formation par le participant lui-  
même (auto-évaluation) et/ou le  
formateur selon les modalités de  
la formation.
- Evaluation de l'action de  
formation en ligne sur votre  
espace participant :
  - ▶ A chaud, dès la fin de la  
formation, pour mesurer votre  
satisfaction et votre perception  
de l'évolution de vos  
compétences par rapport aux  
objectifs de la formation. Avec  
votre accord, votre note globale  
et vos verbatims seront publiés  
sur notre site au travers d'Avis  
Véifiés, solution Certifiée NF  
Service
  - ▶ A froid, 60 jours après la  
formation pour valider le  
transfert de vos acquis en  
situation de travail

Code  
**302**

Durée  
**Sur-mesure / 7  
heures**

Tarif  
**Nous contacter**

*\*Repas inclus (en présentiel)*

## Objectifs pédagogiques

- Exploiter les avantages pratiques des ETF dans sa gestion
- Expliquer les étapes du processus d'émission des ETF par les banques
- Décrire le processus de formation des prix de marché

## Programme de la formation

### Engagement

Vous vous engagez dans votre formation. Connectez-vous sur votre espace participant et complétez votre questionnaire préparatoire. Votre formateur reçoit vos objectifs de progrès.

### Caractéristiques des Exchange Traded Funds / Trackers

- Développement du marché du Tracker
- Les acteurs : émetteurs et investisseurs
- Les différentes gammes : géographique, les sous-jacents : actions, taux, mixte etc.
- Comparaison des ETF avec d'autres instruments financiers : Futures, CFD, OPCVM indiciels
- Etude de cas : analyse comparée de couverture par ETF et Futures

### Les aspects de prix

- Animation du carnet d'ordres par les Market-makers
- Marché primaire et marché secondaire
- La valeur liquidative indicative
- Les frais de gestion
- Les dividendes et coupons attachés
- La fiscalité : Etats-Unis et Europe

### Les différents types d'ETF

- Indices actions : réplication d'indice, levier sur indice, indice short
- Différences entre ETF physique et ETF synthétique
- Commodities
- ETF actif

- Suivi des présences et remise
- d'une attestation individuelle de formation ou d'un certificat de réalisation

### **ACCOMPAGNEMENT FORMATION À DISTANCE**

En cas de nécessité, une assistance technique et pédagogique est joignable entre 8h30 et 18h (jours ouvrés):

- par téléphone : 01 83 10 10 10
- par mail : [care-formation@lefebvre-dalloz.fr](mailto:care-formation@lefebvre-dalloz.fr)

Une réponse immédiate est apportée ; si besoin, le demandeur est mis en relation avec un expert dans un délai maximum de 48h.

- Etude de cas : schéma d'émission d'un ETF dans une banque et gestion du risque

### Utilisation des Exchange Traded Funds / Trackers

- Investissement indiciel
- Couverture : sur portefeuille action, arbitrage, long / short Equity
- Gestion core-satellite
- Allocation sectorielle et géographique
- TP Excel : mise en place et suivi de stratégie de gestion à base d'ETF

### Transfert

Votre parcours de formation se poursuit dans votre espace participant. Connectez-vous pour accéder aux ressources et faciliter la mise en œuvre de vos engagements dans votre contexte professionnel.

### **A noter**

... \_\_\_\_\_

En amont et en aval de la formation, le positionnement pédagogique sera effectué à l'aide d'un questionnaire d'auto-positionnement.