

PUBLIC

Gérants en multigestion – Gérants diversifiés – Assistants gérants – Equipes sales Fixed Income – Managers et collaborateurs des équipes commerciales en banque d'affaires, en société de gestion en banque privée – Analystes quantitatifs – Equipes de coverage – Senior bankers – Risk managers – Direction des risques – Managers et collaborateurs de Middle et Back Office Fixed Income – Département valorisation – Dépositaires – Cabinets de courtage – CIF – CGPI – Family Offices – Consultants SSII Asset Management en inter contrat

PRÉ-REQUIS

Avoir une première connaissance du sujet et une pratique suffisante de l'Anglais

NIVEAU D'EXPERTISE

Expertise

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

Code
547

Durée
2 jours / 14 heures

Tarif Inter*
2 135 € HT

*Repas inclus (en présentiel)

Objectifs pédagogiques

- Identifier les paramètres de gestion d'un portefeuille obligataire
- Exposer les différences des principaux instruments (taux fixe, taux variable, indexés, dérivés) dans un portefeuille obligataire et leurs avantages respectifs
- Mettre en pratique les stratégies de gestion

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.

Identifier les paramètres de gestion d'un portefeuille obligataire

Valoriser une obligation

- Construction d'une courbe de taux
- Actualisation d'une courbe de taux
- Analyser une obligation : en duration, en sensibilité, en convexité
- TP Excel : exercices d'application

Exposer les différences des principaux instruments (taux fixe, taux variable, indexés, dérivés) dans un portefeuille obligataire et leurs avantages respectifs

Elaborer un portefeuille obligataire

- Principes de construction d'un portefeuille obligataire Approche selon les types de gestion : assurantielle, indicielle, avec indice de référence
- Calibrage du processus : tracking-error, ratios de risque
- TP Excel : mise en place ligne à ligne d'un portefeuille

Mettre en pratique les stratégies de gestion

Lister les stratégies de gestion d'un portefeuille obligataire

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 Vérifiés, solution Certifiée NF Service

- ▶ A froid, 60 jours après la formation pour valider le transfert de vos acquis en situation de travail
- 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

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

- Gestion de la sensibilité (utilisation des contrats futures) : gestion de la courbe, analyse en valeur relative, investissements en émetteurs privés
- TP Excel : exercices d'application
- Utiliser des Asset Swaps : caractéristiques d'un Asset Swap, intérêt des Asset Swaps en gestion obligataire
- Exercice : changer d'indexation
- Intégrer des Floating Rate Notes : spécificités et valorisation des FRN, intégration dans un portefeuille obligataire
- Cas pratique (Excel)

Utiliser des obligations indexées sur l'inflation

- Spécificités de ces obligations
- Stratégies de gestion
- Exemples de stratégies

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.



Prochaines sessions

...

PARIS

- 2-3 Déc. 2026

A DISTANCE

- 2-3 Déc. 2026

