

# ETF : Structuration, Fonctionnement et Stratégies Avancées de Gestion de Portefeuille

*Lien : https://innov-maroc.com/formation/etf-structuration-fonctionnement-et-strategies-avancees-de-gestion-de-portefeuille*

| DURÉE | RÉFÉRENCE | CATÉGORIE |
| --- | --- | --- |
| **5 jours (35h)** | **FA75** | **Finance de Marché** |

INNOV MAROC

## 🎯 OBJECTIFS DE LA FORMATION

À l'issue de cette formation, vous serez capable de :

- ✔ Comprendre le fonctionnement des Exchange Traded Funds (ETF)
- ✔ Identifier les différents types et structures d’ETF
- ✔ Maîtriser le mécanisme de création et de rachat des parts
- ✔ Analyser la cotation et la liquidité des ETF
- ✔ Comprendre les stratégies de réplication d’indices
- ✔ Utiliser les ETF dans la gestion de portefeuille
- ✔ Évaluer les risques associés aux ETF
- ✔ Analyser la performance et le tracking error
- ✔ Développer des stratégies d’investissement diversifiées
- ✔ Maîtriser le cadre réglementaire des ETF
- ✔ Construire des portefeuilles optimisés avec des ETF
- ✔ Appliquer les ETF dans des stratégies de gestion passive ou active

## 👥 POUR QUI ?

- ✔ Gestionnaires de portefeuille et asset managers
- ✔ Analystes financiers et investisseurs institutionnels
- ✔ Banquiers privés et conseillers en gestion de patrimoine
- ✔ Traders et professionnels des marchés financiers
- ✔ Responsables financiers et trésoriers
- ✔ Investisseurs particuliers avertis
- ✔ Professionnels des banques et institutions financières
- ✔ Toute personne intéressée par les marchés ETF et la gestion d’actifs

INNOV MAROC



## Programme détaillé

### 1 / Introduction aux Exchange Traded Funds (ETF)

- Définition et principes de fonctionnement des ETF
- Rôle des ETF dans les marchés financiers
- Différence entre ETF et fonds d’investissement classiques

### 2 / Typologie des ETF

- ETF actions, obligations et matières premières
- ETF sectoriels et géographiques
- ETF synthétiques et physiques

### 3 / Mécanisme de création et de rachat

- Processus de création/destruction des parts
- Rôle des participants autorisés (AP)
- Arbitrage et maintien de la liquidité

### 4 / Cotation et fonctionnement sur les marchés

- Négociation en continu en bourse
- Formation des prix et tracking error
- Liquidité et spreads

INNOV MAROC

## 5 / Stratégies de montage d’ETF

- Réplication physique vs synthétique
- Structuration de paniers d’actifs
- Optimisation fiscale et financière

## 6 / Utilisation des ETF en gestion de portefeuille

- Allocation d’actifs via ETF
- Diversification simple et efficace
- Gestion passive vs active

## 7 / Risques liés aux ETF

- Risque de marché et volatilité
- Risque de contrepartie (ETF synthétiques)
- Risque de suivi de l’indice

## 8 / Analyse de performance des ETF

- Tracking error et tracking difference
- Indicateurs de performance
- Comparaison entre ETF concurrents

## 9 / Réglementation et cadre juridique

- Normes UCITS et régulation européenne
- Transparence et obligations d’information
- Protection des investisseurs

## 10 / Études de cas et applications pratiques

- Analyse d’ETF réels du marché
- Construction de portefeuille ETF

INOV MAROC

- Stratégies d’investissement institutionnel et particulier

## 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

| | |
|---|---|
| 25 au 29 Jan. 2027 | Présentiel - Casablanca |
| 22 au 26 Mars 2027 | Présentiel - Casablanca |
| 17 au 21 Mai 2027 | Présentiel - Casablanca |
| 12 au 16 Juil. 2027 | Présentiel - Casablanca |
| 06 au 10 Sep. 2027 | Présentiel - Casablanca |

Autres dates possibles sur demande. Contactez-nous pour organiser une session intra-entreprise.

## Réservation & Renseignements

**Téléphone :** +212 522 247 210
**Email :** contact@innov-maroc.com
**Web :** https//www.innov-maroc.com

INNOV MAROC


INNOV MAROC — Tous droits réservés