

Plan de cours 2005-2006**Option principale
Finance & Risk Management****Patrick Hauri****160 heures****Objectifs du cours (en conformité avec le descriptif de module)**

- Présenter les bases de l'économie bancaire et financière afin de comprendre les problèmes et les défis qu'elle représente.
- Présenter et comprendre le cadre légal et réglementaire du système bancaire et financier et la surveillance actuelle en Suisse.
- Acquérir les notions fondamentales de la finance moderne et les connaissances quantitatives (mathématiques financières) et pouvoir les appliquer.
- Présenter et comprendre les instruments financiers dérivés 'classiques', les risques inhérents et les principes d'évaluation ainsi que différents cas de figures pour leur utilisation.
- Connaître les bases de la gestion moderne des risques financiers et non-financiers, ainsi qu'analyser et appliquer les méthodes modernes de gestion des risques.
- Résumer et comprendre les défis futurs du secteur bancaire et financier.

Plan de cours (Contenu détaillé du cours)

Introduction :

- Objectifs du cours
- Déroulement et plan du cours
- Principes
- Examens

Economie bancaire :

- Activités bancaires et marchés financiers
- Prestations et produits bancaires
- Stratégies et management bancaire illustrés sur la base d'analyses SWOT

Surveillance et réglementation :

- Réglementation internationale et cadre légal Suisse – Droit bancaire et financier
- Système de surveillance
- Aspects légaux et de compliance
- Aspects fiscaux

Mathématiques financières :

- Rendements
- Statistique
- Distribution et régression

Finance moderne :

- Théorie moderne du portefeuille
- Evaluation d'actions / titres et de société (Equity)
- Evaluation d'obligations (Fixed Income)
- Evaluation de devises et matières premières (Forex / Commodities)
- Mesure et présentation de la performance

Instruments financiers dérivés :

- Vue d'ensemble et introduction
- Evaluation et mesure des risques
- Problèmes et défis pratiques

Gestion des risques :

- Bases et introduction
- Risques de marché ALM et trésorerie
- Risques de marché Négoce
- Risques de crédit
- Risque opérationnels, risque de réputation et risques stratégiques
- Risque financiers dans le secteur non-bancaire
- Bâle II
- Défis, trends et évolutions futures

Méthodes pédagogiques

Les cours sont conçus pour avoir un lien fort et donner une place prépondérante à la pratique :

- a) Introduction théorique
- b) Exercices pratiques
- c) Etudes de cas et workshops
- d) Orateurs et invités externes du monde bancaire et financier.

Participation active au cours, discussion et réflexion durant le cours, préparation avant et après le cours, travaux individuels et de groupe.

Mode d'évaluation (en conformité avec le descriptif de module)

- Examen écrit, semaine 5 :
 - Economie bancaire
 - Surveillance et réglementation
 - Mathématique financière
 - Finance moderne
 - Instruments financiers dérivés.
- Examen oral, semaine 20 :
 - Gestion des risques.
- Travail de groupe :

Pondération : 1/3 pour chaque note

Bibliographie

Distribution d'un support de cours ainsi que d'articles techniques et de presse, extraits de bibliographie et autres documents (rapports annuels, lois et ordonnances, ...) durant le cours en fonction des sujets traités.