

IAE DE NICE

Spécialité : Master 1 Finance Comptabilité ; Master 1 Management

PRECISER SEMESTRE : S2

INTITULE DU COURS : FINANCIAL STRATEGY

RESPONSABLE : PIERRE YVES DITTLOT // OLIVIER GAULTIER

FONCTION : PROFESSEUR ASSOCIE

ECTS* : 3

VOLUME HORAIRE : 20H

DESCRIPTIF ET OBJECTIFS GENERAUX DU COURS (5 A 6 LIGNES)

Ce module est constitué de 2 cours magistraux suivis de 4 TD en groupes.

Les objectifs du cours sont les suivants :

1. Introduction aux marchés financiers et aux principaux index des bourses internationales
2. Relier les mécanismes macro économiques aux évolutions des marchés financiers
3. Analyser et évaluer les facteurs de risques attachés à un investissement
4. Elaborer une stratégie d'investissement financier : connaître les différentes classes d'actifs, définir une politique de gestion des risques
5. Constituer un portefeuille d'investissement et mesurer son risque

PLAN DU COURS

Les 2 cours magistraux (2 x 3 = 6 heures) portent sur les notions suivantes :

1. La théorie moderne des marchés et le rôle des marchés financiers
2. Les mécanismes macro économiques et leur influence sur les marchés financiers
3. Le rendement et les risques inhérents à un investissement financier : nature, évaluation ; modèles CAPM, Markowitz
4. Les principales classes d'actif dans un portefeuille d'investissement financier : actions, obligations, devises, dérivés

Les sessions de TD (4 x 2,5 = 10 heures) portent sur les thèmes suivants :

1. TD1 = les index des bourses internationales : contenu, rôle, évolutions
2. TD2 = évaluer, mesurer et comparer les indicateurs de risques de 2 portefeuilles
3. TD3 = paramétrer des bases de données EXCEL et des formules de calcul d'indicateurs de risques de différents portefeuilles ; interpréter les résultats
4. TD4 = test

MODE D'EVALUATION

EXERCICE PRATIQUE EN TD=25% ; TEST EN TD = 25% ; EXAMEN FINAL =50%

REFERENCES BIBLIOGRAPHIQUES