

عنوان الماستر: مالية وتجارة دولية

السداسي: الثاني

اسم الوحدة: وحدة التعليم الأساسية

الرمز: وت أس 2.1

اسم المادة: إدارة المحافظ المالية

الرصيد: 04

المعامل: 02

نمط التعليم: حضوري

أهداف التعليم: الهدف من تدريس هذه المادة والمتعلقة بإدارة المحافظ الاستثمارية هو تمكين طالب الماستر من فهم وبشكل معمق نظرية المحفظة الاستثمارية وكيفية إدارتها وكذا الربط بين العائد والمخاطرة وكيفية قياسهما، مع شيء من التحليل لتركيبية مثل هذه المحافظ وتقييم أدائها مع التعرض لبعض النماذج لحافظ الاستثمار.

المعارف المسبقة المطلوبة:

ليتمكن الطالب من دراسة هذه المادة يجب أن يكون ملماً بمفهوم الاستثمار الذي تقوم به البنوك التجارية والمؤسسات المالية المختلفة وصناديق الاستثمار. كما يجب على الطالب أن تكون له معلومات مسبقة حول آليات توظيف الأموال في البورصات والأسواق المالية المختلفة.

محتوى المادة:

المحور الأول: مفهوم المحفظة المالية.

المحور الثاني: نماذج تقييم المحافظ المالية

المحور الثالث: العائد والمخاطرة في المحفظة المالية.

المحور الرابع: التنويع الأمثل ونظرية ماركويتز.

المحور الخامس: نموذج تسعير الأصول الرأسمالية CAMP.

المحور السادس: نموذج شارب والعلاقة بين العائد والمخاطرة.

المحور السابع: نماذج أخرى لتسعير الأصول المالية.

المحور العاشر: صناديق الاستثمار.

المحور الحادي عشر: إستراتيجية بناء المحافظ المالية.

المحور الثاني عشر: العائد والمخاطرة في الاستثمارات الفردية.

طريقة التقييم: تقييم مستمر + امتحان نهائي ويقاس معدل المادة بالوزن الترجيحي للدروس (60%) والأعمال الموجهة (40%)

المراجع:

1. أسامة عبد المنعم الخولي، المحاسبة في صناديق الاستثمار، دار التعليم الجامعي، الإسكندرية مصر، 2010
2. دريد كامل الشبيب، إدارة المحافظ الاستثمارية، الطبعة الثانية، دار المسيرة للنشر والتوزيع، عمان، الأردن، 2015
3. عاطف وليم أندراوس، "السياسات المالية وأسواق الأوراق المالية خلال فترة التحول لاقتصاد السوق"، مؤسسة شباب الجامعة، الإسكندرية، 2005
4. منير إبراهيم هندی، "أساسيات الاستثمار وتحليل الأوراق المالية، الطبعة الثالثة، المكتب العربي الحديث، الإسكندرية مصر، 2015.