

عنوان الماستر: الإدارة المالية

السداسي: الثاني

اسم الوحدة: وحدة تعليم أساسية

اسم المادة: إدارة المحفظة المالية

الرصيد: 05

المعامل: 02

نمط التعليم: حضوري

أهداف التعليم:

تهدف هذه المادة إلى تعريف الطالب بماهية المحافظ الاستثمارية والنظريات والأسس الحديثة في إدارتها، الأوراق المالية وتطبيقاتها العملية، ونظرية المحفظة، وأسس تقييم الاستثمار في الأوراق المالية، وتشكيل المحافظ الاستثمارية المتنوعة، دراسة الاتجاهات الحديثة في أدارة المحافظ الاستثمارية، ومقدمة عن كفاءة السوق المالي.

المعارف المسبقة المطلوبة:

الأسواق المالية

محتوى المادة:

1. الاستثمار في المحفظة المالية

- العائد والمخاطرة في الاستثمارات الفردية

- العائد والمخاطرة في المحفظة

- التنويع الأمثل ونظرية Markowitz

- منحنى الاستثمارات المثلى

2. نماذج تسعير الأصول المالية

- العلاقة بين العلاقة بين العائد والمخاطرة في المحفظة

- نموذج شارب والعلاقة بين العائد والمخاطرة في الاستثمار الفردي واستثمار السوق.

- نماذج أخرى لتسعير الأصول المالية.

3. صناديق الاستثمار

- تاريخ ونشأة صناديق الاستثمار.

- استراتيجيات بناء المحافظ المالية

- نماذج تقييم المحافظ الاستثمارية

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

المراجع:

- Ginger Levin, P. M. P., & John Wyzalek, P. (Eds.). (2014). Portfolio management: A strategic approach. CRC Press.
- Grinold, R. C., & Kahn, R. N. (2000). Active portfolio management.
- Reilly, F. K., & Brown, K. C. (2011). Investment analysis and portfolio management. Cengage Learning.
- Smithson, C. (2003). Credit portfolio management (Vol. 227). John Wiley & Sons.