

عنوان الماستر: إقتصاد نقدي ومالي

السداسي: الثالث

الوحدة الأساسية: الهندسة المالية

الأرصدة: 06

المعامل: 03

أهداف التعليم: يهدف هذا المقرر إلى تعزيز فهم الطالب للجوانب النظرية والعملية للهندسة المالية، وكذلك معرفة أحدث الأدوات والأساليب لإنشاء منتجات مالية مبتكرة وإيجاد الحلول الخلاقة لمشاكل التمويل وإدارة المخاطر، فيستطيع التحوط والمضاربة والمراجعة في الأسواق المالية العالمية بالمشنقات المالية، والإلمام بجوانب الهندسة المالية الإسلامية.

المعارف المسبقة المطلوبة: الأسواق المالية (خاصة التسعير وتقييم الأوراق المالية)، والأسواق المالية الدولية، الأدوات المالية التقليدية، إدارة المخاطر.

محتوى المادة:

المحور الأول: مدخل عام للهندسة المالية؛

المحور الثاني: منتجات صناعة الهندسة المالية؛

المحور الثالث: أدوات الهندسة المالية (المشنقات)؛

المحور الرابع: عقود الخيارات؛

المحور الخامس: تقييم الخيارات في الزمن المتقطع (نموذج ثنائي الحد)؛

المحور السادس: تقييم الخيارات في الزمن المستمر (بلاك سكولز)؛

المحور السابع: العقود الآجلة والعقود المستقبلية؛

المحور الثامن: عقود المقايضات (المبادلات)؛

المحور التاسع: الهندسة المالية الإسلامية.

طريقة التقييم: تقييم مستمر وامتحان نهائي 60% للمحاضرة و 40% للأعمال موجهة.

المراجع:

- المشنقات والهندسة المالية، فريد النجار، الدار الجامعية، الإسكندرية، 2008.
- مبادئ الهندسة المالية، علي عبد القادر بن الضب، دار حامد للنشر والتوزيع، عمان، 2020.
- Financial derivatives,R.W.KOL and J.A.OVERDAHL, John Wiley and Sons,third Edition2003.