

عنوان الماستر: اقتصاد نقدي ومالي

السداسي: الثاني

إسم المادة : تسيير المحافظ المالية

الأرصدة: 05

المعامل: 02

أهداف التعليم: كسب المعرفة النظرية والعملية في تسيير (إدارة) المحفظة المالية، رقد سوق العمل المحلي والإقليمي بخريجين مؤهلين في مجال تسيير المحفظة المالية، بالإضافة إلى التمكين من إدارة المخاطر المالية المتعلقة بالمحفظة المالية، استكمال معارف الطالب في التخصص والتعمق فيه.

المعارف المسبقة المطلوبة: الأسواق المالية؛ إدارة المخاطر؛ إدارة المحفظة الاستثمارية.

محتوى المادة:

المحور الأول: ماهية المحفظة المالية؛

المحور الثاني: تحليل المحفظة المالية (العائد، المخاطرة وتسعير المخاطر)؛

المحور الثالث: نموذج تسعير الأصول الرأسمالية (تسعير المخاطر)؛

المحور الرابع: النماذج البديلة لنموذج تسعير الأصول الرأسمالية؛

المحور الخامس: إدارة المحفظة المالية؛

المحور السادس: تقييم أداء المحفظة المالية؛

المحور السابع: إدارة مخاطر المحفظة المالية واستراتيجيات التحوط.

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

المراجع:

- جبار محفوظ "الأسواق المالية: استراتيجيات الاستثمار والتحوط"، الجزء الثالث، دار هومة للطباعة والنشر والتوزيع، الجزائر 2017.

-Alphonse P,Desmuliers, G,Grandin, P, Levasseur, M,Gestion de portefeuille et marchés financiers, Pearson, 2010.

-Jacquilat B,& B. Solnik, Marchés Financiers : Gestion des portefeuilles et des risques, Dunod, 1989.