



## SYLLABUS منهاج المادة التعليمية

الميدان : العلوم الاقتصادية، علوم التسيير و العلوم التجارية (D 06) الشعبة : علوم التسيير

التخصص : إدارة مالية

السنة الجامعية : 2018-2019

السداسي : الخامس

### التعرف على المادة التعليمية

العنوان : ادارة المحفظة المالية

وحدة التعليم : الوحدة الأساسية

عدد الأرصدة : / المعامل : 2

الحجم الساعي الأسبوعي : 03 ساعة

المحاضرة ( عدد الساعات في الأسبوع ) : 1.5 ساعة

أعمال توجيهية ( عدد الساعات في الأسبوع ) : 1.5 ساعة

أعمال تطبيقية ( عدد الساعات في الأسبوع ) : /

### مسؤول المادة التعليمية

الاسم، اللقب، الرتبة : بن علي سمية، أستاذة محاضرة قسم ب

تحديد موقع المكتب ( مدخل ، مكتب ) : /

البريد الإلكتروني : benalisoumya@yahoo.fr

رقم الهاتف : 06 59 36 81 20

توقيت الدرس ومكانه : /

### وصف المادة التعليمية

- المكتسبات (Pré requis) :**  
التحكم في بعض الأدوات المالية المستخدمة لإدارة محفظة الأوراق المالية  
الهدف العام للمادة التعليمية :  
الاطلاع على مختلف المفاهيم النظرية والتطبيقية لمختلف الاستراتيجيات المتبعة لإدارة محفظة الأوراق المالية.  
أهداف التعلم (المهارات المراد الوصول إليها) : ( من 3 إلى 6 أسطر مع التركيز فقط على الأهداف التي يتم تقييمها)  
- التحكم في المفاهيم النظرية الخاصة بالأصول المالية ونظرية المحفظة  
- استخدام بعض النماذج المالية لتقييم أداء المحافظ المالية  
- التعرف على أهم الاستراتيجيات المتبعة في إدارة محفظة الأوراق المالية وكيفية تطبيقها

### محتوى المادة التعليمية

- 1-الأصول والمؤشرات المالية
  - 2- نظرية المحفظة المالية
  - 3- استراتيجيات إدارة المحفظة المالية
  - 4- نموذج توازن الأصول المالية
  - 5- نظرية التسعير بالمراجعة
  - 6- قياس أداء المحافظ المالية
- يمكن الاضافة في صفحة أخرى، عند الحاجة



### طرق التقييم

التقييم بالنسبة المئوية	طبيعة الامتحان
50 %	امتحان
25 %	امتحان جزئي
12.5 %	أعمال موجهة
	أعمال تطبيقية
	المشروع الفردي
	الأعمال الجماعية (ضمن فريق)
	خرجات ميدانية
06.25%	المواظبة (الحضور / الغياب)
06.25%	عناصر أخرى (المشاركة في القسم)
100%	المجموع

### المصادر والمراجع

المرجع الأساسي الموصى به :

عنوان المرجع	المؤلف	دار النشر و السنة

مراجع الدعم الإضافية (إن وجدت):

عنوان المرجع الأول	المؤلف	دار النشر و السنة
عنوان المرجع الثاني	المؤلف	دار النشر و السنة



**المخطط الزمني المرتقب**

التاريخ	محتوى الدرس	الأسبوع
	مدخل إلى الأصول المالية والمؤشرات (المفاهيم الأساسية و الخصائص)	الأسبوع الأول
	نظرية المحفظة المالية (الفرضيات الأساسية، الثنائية عائد - خطر، خصائص المحافظ المالية المكونة من أصلين ماليين )	الأسبوع الثاني
	المحفظة المالية المكونة من N أصل	الأسبوع الثالث
	تحديد الحد الكفاء و المحفظة المثلى	الأسبوع الرابع
	استراتيجيات إدارة المحافظ المالية	الأسبوع الخامس
	إدارة محفظة السندات (تطبيقات)	الأسبوع السادس
	نموذج توازن الأصول المالية (فرضيات النموذج، صيغة النموذج،)	الأسبوع السابع
	نظرية التسعير بالمراجعة	الأسبوع الثامن
	مدخل إلى قياس أداء المحافظ المالية (عرض لأهم نماذج التقييم، مقياس شارب، ترينور وجونسن)	الأسبوع التاسع
	تطبيقات	الأسبوع العاشر
	امتحان جزئي	الأسبوع الحادي عشر
	مراجعة + إرجاع لمختلف نقاط التقييم خلال السداسي وتقديم العلامة النهائية للأعمال الموجة	الأسبوع الثاني عشر
	امتحان نهاية السداسي	الأسبوع الثالث عشر
	الامتحان الاستدراكي	-