

SYLLABUS منهاج المادة التعليمية

إدارة المحافظ الإستثمارية Investment Portfolio Management

الميدان : العلوم الاقتصادية و علوم التسيير و العلوم التجارية (D06). الشعبة: العلوم المالية
التخصص : ماستر 1 مالية المؤسسة

السنة الجامعية : 2019 /2018

السادسي : الأول S1

التعرف على المادة التعليمية

العنوان : إدارة المحافظ الإستثمارية

وحدة التعليم : منهجية

عدد الأرصة : 05 المعامل : 02

الحجم الساعي الأسبوعي : ثلاثة (03) ساعات

المحاضرة (عدد الساعات في الأسبوع) : 1.30 سا

أعمال توجيهية (عدد الساعات في الأسبوع) : 1.30 سا

أعمال تطبيقية (عدد الساعات في الأسبوع) : /

مسؤول المادة التعليمية

الاسم، اللقب، الرتبة : لمياء أوضايفية ، أستاذ محاضر (أ).

تحديد موقع المكتب (مدخل ، مكتب) : /

البريد الإلكتروني : lamiaoudaifia@gmail.com

رقم الهاتف : 0669587033

توقيت الدرس ومكانه : يوم الأحد 11:00-12:30 القاعة:109، الخميس: 9:30-14:00 القاعات:

21،22،23

وصف المادة التعليمية

المكتسبات (Pré requis) :

مفهوم 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.

الهدف العام للمادة التعليمية :

الهدف من تدريس إدارة 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 أداءها مع التعرض لبعض النماذج لمحافظ الاستثمار.

أهداف التعلم (المهارات المراد الوصول إليها) :

1. مفهوم المحفظة وأهميتها وأهدافها.
2. فهم نظرية المحفظة.
3. تحليل العائد والمخاطر للمحفظة.
4. فهم بعض نماذج المحافظ الاستثمارية.

محتوى المادة التعليمية

موضح حسب الجدول الزمني المرفق

يمكن الاضافة في صفحة أخرى، عند الحاجة

طرق التقييم

طبيعة الامتحان	العلامة	التقييم بالنسبة المئوية
امتحان	20	50%
امتحان جزئي	12	30%
أعمال موجهة	5	12.5%
أعمال تطبيقية	/	/
المشروع الفردي	/	/
الأعمال الجماعية (ضمن فريق)	/	/
استجاب (Quizz)	/	/
المواضبة (الحضور / الغياب)	3	7.5%
عناصر أخرى (يتم تحديدها)		
المجموع		100%

المصادر والمراجع

المرجع الأساسي الموصى به :

عنوان المرجع	المؤلف	دار النشر و السنة
إدارة المحافظ الاستثمارية	آل شبيب دريد كامل	دار المسيرة، عمان، 2015

مراجع الدعم الإضافية (إن وجدت):

عنوان المرجع الأول	المؤلف	دار النشر و السنة
إدارة المحافظ الاستثمارية	خريوش حسين علي	دار زهوان، عمان، 2010
عنوان المرجع الثاني	المؤلف	دار النشر و السنة
Investment	Bodie Z, Kane A	2005

المخطط الزمني المرتقب

التاريخ	محتوى الدرس	الأسبوع
/	مقدمة في الاستثمار	الأسبوع الأول
/	الأوراق المالية	الأسبوع الثاني
/	أسواق الأوراق المالية وصناديق الاستثمار	الأسبوع الثالث
/	مقدمة في المحافظ الاستثمارية	الأسبوع الرابع
/	نظرية المحفظة الاستثمارية	الأسبوع الخامس
/	إدارة المحفظة الاستثمارية	الأسبوع السادس
/	العائد والمخاطر	الأسبوع السابع
/	قياس العائد والمخاطر في المحفظة	الأسبوع الثامن
/	تحليل بيئة الاستثمارات في المحفظة الاستثمارية	الأسبوع التاسع
/	تحليل المحفظة الاستثمارية	الأسبوع العاشر
/	نماذج المحافظ الاستثمارية	الأسبوع الحادي عشر
/	تقييم أداء المحافظ الاستثمارية	الأسبوع الثاني عشر
/	امتحان جزئي	الأسبوع الثالث عشر
/	امتحان نهاية السداسي	الأسبوع الرابع عشر
/	الامتحان الاستدراكي	-

أستاذة الأعمال الموجهة :

أ. كواشي حنان

الأستاذة (ة) المحاضر(ة) :

د. أوضافية لمياء

