بسم الله الرحمن الرحيم

جامعة آل البيت

جامعة آل البيت
دائرة ضمان الجودة والتخطيط

كلية الاقتصاد والعلوم الإدارية
قسم التمويل والمصارفة

توصيف مساق ادارة المحافظ الاستثمارية

1. معلومات مدرس المساق (Instructor)

اســـم (مدرس / منسق) المساق :	عمر خليف مصطفى غرايبة
الساعـــــات المكتبيـــــــــــة :	الساعة 9 الى 10
رقم المكتب والرقـــم الفرعـــــي :	
البريـــــــــد الالكترونـــــــــي :	Omar.k.gharaibeh@gmail.com
مساعد البحث والتدريس/المشرف/الفني (إن وجد):	

2. وصف المساق (Course Description)

نظريات تكوين وإدارة محافظ الأوراق المالية؛ أسس تقييم الاستثمار في الأوراق المالية؛ تحليل العوائد والمخاطر؛ تنويع المحفظة وتوزيع المخاطر؛ نظريات سوق رأس المال؛ نموذج تسعير الأصول الرأسمالية؛ اختيار محافظ الاستثمار الكفؤة؛ قياس أداء محافظ الاستثمار؛ تطبيقات عملية على مستوى الأفراد والمشروعات والمؤسسات الاستثمارية؛ والمحافظ الاستثمارية في الإسلام.

3. بيانات المساق (Course Title)

رقم المساق: 503341	**اسم المساق: ادارة المحافظ الاستثمارية**	**المستوى: بكالوريس**
طبيعة المساق: نظري + عملي	**المتطلب السابق : مبادئ الاستثمار**	**وقت المحاضرة: 10:30-11:30**
العام الجامعي: 2018 / 2019	**الفصل الدراسي: الصيفي**	**عدد الساعات الدراسية: 48 ساعة**

4. أهداف المساق (Course Objectives)

أ-	القدرة على تحليل العوائد والمخاطر
ب-	القدرة على تنويع المحفظة وتوزيع المخاطر
ج-	القدرة على تكوين وإدارة محافظ الاوراق المالية
د-	القدرة على بناء محافظ استثمارية كفؤة

5. مخرجات التعلم (Intended Student Learning Outcomes)

(المعرفة والمهارات والكفايات)

يفترض بالطالب بعد دراسته لهذا المساق أن يكون قادرا على:

1. حساب عائد ومخاطر السهم او الورقة المالية.
2. حساب عائد ومخاطر المحفظة الاستثمارية بناء على طريقة Harry Markowitz.
3. حساب عائد ومخاطر المحفظة الاستثمارية بناء على طريقة Sharpe.
4. حساب عائد ومخاطر المحفظة الاستثمارية المثلى بناء على طريقة Treynor.
5. القدرة على تقليل المخاطر من خلال المعرفة في حساب الارتباط وعدد الأوراق المالية والأوزان.
6. معرفة فرضية السوق الكفء EMH والإلمام بالمالية السلوكية.

6. محتوى المساق (Course Content)

الأسبوع	الموضــوع
الأول	Principle of Statistics Concepts
الثاني	Principle of Statistics Concepts
الثالث	An Introduction to Portfolio Management
الرابع	An Introduction to Portfolio Management
الخامس	Mean-Variance Portfolio
السادس	Mean-Variance Portfolio
الامتحان الأول	
الثامن	An Introduction to Asset Pricing Model
التاسع	An Introduction to Asset Pricing Model
العاشر	Portfolio Based on Sharpe Index
الحادي عشر	Portfolio Based on Sharpe Index
الامتحان الثاني	
الثالث عشر	Optimal Portfolio Based on Treynor Index
الرابع عشر	Efficient Market
الخامس عشر	Efficient Market
السادس عشر	**الامتحان النهائي**

7. استراتيجيات التعليم والتعلم وطرق التقويم (Teaching and learning Strategies and Evaluation Methods)

ت	مخرجات التعلم	استراتيجيات التدريس	أنشطة التعلم	نوع التقويم/القياس (امتحان/عروض صفية/مناقشة/واجبات)
1	**يتعرف على نظريات ونماذج المحافظ الاستثمارية**	**المحاضرة أسئلة وأجوبة التدريبات والتمارين**	**عرض أمثلة تلخيص الأفكار مقارنة النظريات والنماذج**	**امتحان مناقشات داخل المحاضرة**
2	**يطبق مبادئ وطرق انشاء المحفظة الاستثمارية**	**المحاضرة أسئلة وأجوبة التدريبات والتمارين**	**عرض أمثلة تلخيص الأفكار مقارنة النظريات والنماذج**	**امتحان مناقشات داخل المحاضرة واجبات**
3	**يصمم محفظة استثمارية متنوعة**	**المحاضرة أسئلة وأجوبة التدريبات والتمارين**	**عرض أمثلة تلخيص الأفكار مقارنة النظريات والنماذج**	**امتحان مناقشات داخل المحاضرة واجبات**
4	**يحلل ويقيم المحفظة التي صممها**	**المحاضرة أسئلة وأجوبة التدريبات والتمارين**	**عرض أمثلة تلخيص الأفكار مقارنة النظريات والنماذج**	**امتحان مناقشات داخل المحاضرة واجبات**

8. تقييم الطلبة (Assessment)

الأساليب المستخدمة	توقيت التقييم	توزيع الدرجات لكل أسلوب
1-أعمال الفصل: (تقرير، وظائف، حضور)	خلال الفصل	10
2-امتحان تحريري أول	الأسبوع السابع	20
2-امتحان تحريري ثاني	الأسبوع الثاني عشر	20
3-امتحان تحريري نهائي	أسبوع الامتحانات النهائية	50

9. الكتاب المقرر (Text Book)

المرجع الرئيس	**Investment Analysis and Portfolio Management**
المؤلف	**Frank K. Reilly & Keith C. Brown**
الناشر	**Cengage Learning products are represented in Canada by Nelson Education, Ltd.**
السنة	**2012-2009**
الطبعة	**Tenth Edition**
الموقع الالكتروني للمرجع	**https://s3.amazonaws.com/sitebooks/Long+Term+Investing/Investment+Analysis+and+Portfolio+Management+(2012).pdf**

10. المراجع الإضافية (References) (وتشمل الكتب والبحوث المنشورة في الدوريات او المواقع الالكترونية)

-1	
-2	
-3	