

برنامج مقياس إدارة المحافظ المالية.

المحور الأول: مدخل إلى الأسواق المالية

المحور الثاني: فهم المحافظ المالية.

أولاً: أساسيات حول المحفظة المالية؛

- I. تعريف المحفظة المالية؛
- II. الفرق بين المحفظة الاستثمارية والمحفظة المالية؛
- III. أهداف المحفظة المالية؛
- IV. أنواع المحفظة المالية؛
- V. قيود بناء المحفظة المالية.

ثانياً: إدارة حول المحفظة المالية؛

- I. تعريف إدارة المحفظة المالية.
- II. مزايا إدارة المحافظ المالية.
- III. استراتيجيات إدارة المحافظ المالية.
- IV. التحديات التي تواجه إدارة المحافظ المالية.

المحور الثالث: العائد والمخاطرة في المحافظ المالية.

أولاً: العائد.

- I. تعريف العائد؛
 - II. أنواع العائد؛
- ثانياً: المخاطرة.
- I. تعريف المخاطرة؛
 - II. أنواع المخاطر؛
 - III. قياس المخاطر؛
 - IV. مصطلحات ذات الصلة بالمخاطرة؛
 - V. ميولات المستثمرين تجاه المخاطر.
- ثالثاً: حساب عائد ومخاطر المحفظة المالية.
- I. حساب عائد المحفظة المالية؛

II. حساب مخاطر المحفظة المالية.

المحور الرابع: نماذج إدارة المحافظ المالية.

أولاً: نموذج شارب.

ثانياً: نموذج تسعير الأصول الرأسمالية.

ثالثاً: نموذج خط سوق رأس المال.

رابعاً: نموذج الترجيح.

المحور الخامس: تقييم المحافظ المالية.

أولاً: الأسلوب البسيط.

أولاً: الأسلوب المزدوج.

I. نموذج ترينور:

II. نموذج شارب.

III. نموذج جونسن.

IV. نموذج فاما.

V. مؤشر الأداء المعدل بالمخاطرة.