دليل المادة التعليمية Syllabus

اسم المادة: إدارة المحافظ المالية

الميدان:	علوم اقتصادية وعلوم تجارية وعلوم التسيير	**الفرع الشعبة:**	علوم تجارية
التخصص:	مالية وتجارة دولية	**المستوى:**	أولى ماستر
السداسي:	الثاني	**السنة الجامعية:**	2025/2024

التعرف على المادة التعليمية

اسم المادة	إدارة المحافظ المالية	**وحدة التعليم**	أساسية
عدد الأرصدة	4	**المعامل**	2
الحجم الساعي الأسبوعي	6ساعة	**المحاضرة (عدد الساعات فيالأسبوع)**	1.5 ساعة
أعمال م/تط (عدد الساعات في الأسبوع)	/	**أعمال م/ت (عدد الساعات في الأسبوع)**	3.5 ساعة

مسؤول المادة التعليمية

الاسم، اللقب	**بن ابراهيم الغالي**	**الرتبة**	**أستاذ**
تحديد موقع المكتب	**مكتبة الكلية رقم 24**	**البريد الالكتروني**	elghali.benbrahim@univ-biskra.dz
رقم الهاتف	**0555468915**	**توقيت الدرس ومكانه**	**الإثنين 09:40 القاعة 102**

وصف المادة التعليمية

المكتسبات	لفهم واستيعاب المقياس يجب أن يكون الطالب ملما ومتمكنا من معارف سابقة درسها في مقايس مختلفة، وهي: التقنيات البنكية؛ ◉ الأسواق المالية الدولية وأدواتها؛ ◉ بورصة الأوراق المالية؛ ◉ الاقتصاد النقدي؛ ◉ الإحصاء التطبيقي والاحتمالات.
الهدف العام للمادة التعليمية	يكمن الهدف من المقياس في تمكين الطالب من فهم وبشكل معمق وبأسلوب تحليلي للمعارف النظرية والعملية حول المحفظة المالية، وإدارتها، قياس عائد ومخاطر للمحفظة وأدواتها المالية، ونماذج إدارة المحفظة المالية وطرق تقييمها.
أهداف التعلم (المهارات المراد الوصول إليها)	**اكتساب الطالب لمهارات تسمح له بـ:1.** 1. تكوين فكرة عن أهم التقنيات والاستراتيجيات المعتمدة في بناء وإدارة المحفظة المالية؛ 2. القدرة على تحديد وقياس والسيطرة ومراقبة المخاطر التي تواجه المحافظ المالية؛ 3. زيادة الرصيد المعرفي للطالب وتكملة لمعارف سابقة حول مقاييس تم دراستها لها علاقة بمقياس إدارة المحافظ المالية؛

	4. تدعيم ومساعدة الطالب في فهم مقاييس قيد الدراسة في الحاضر ومستقبلا في مستويات أعلى؛

محتوى المادة التعليمية

المحور الأول	مدخل إلى للأسواق المالية
المحور الثاني	فهم المحفظة المالية
المحور الثالث	عائد ومخاطر المحفظة المالية
المحور الرابع	نماذج إدارة المحافظ المالية.
المحور الخامس	تقييم المحافظ المالية.

طريقة التقييم

التقييم بالنسبة المئوية	**العلامة**		**الوزن النسبي للتقييم**		
امتحان	**20/20**		**وزن المحاضرة**	**% 60**	**% 60**
امتحان جزئي 1	**08**	**20**	**وزن الأعمال الموجهة والتطبيقية**	**% 40**	**%20**
أعمال موجهة (البحث: إعداد/إلقاء)	**04**				**-**
أعمال تطبيقية	**-**				**-**
المشروع الفردي	**-**				**-**
الأعمال الجماعية (ضمن فريق)	**-**				**-**
خرجات ميدانية	**-**				**-**
المواظبة (الحضور/ الغياب)	**6**				**% 06**
عناصر أخرى (المشاركة)	**2**				**14%**

بالنسبة للمواد التي تدرس في شكل محاضر اتوأعمال موجهة/تطبيقية أو طبيعة تقييمها امتحان و مر اقبة مستمرة يقاس معدل المادة بالوزن الترجيحي للمحاضرة والأعمال الموجهة:

نقطة المحاضرة * 0.6 + نقطة الأعمال الموجهة * 0.4=	**معدل المادة**
= (Note Ex * 0.6) + (Note Td * 0.4)	***Moy.M***

المصادروالمراجع (موحدة وطنيا)

المرجع الأساسي الموصي به : فرد وستون و يوجين برجام ترجمة عبد الرحمن دعالة بيك و عبد الفتاح السيد النعماني : التمويل الإداري ، الجزء الثاني ، دار المريخ للنشر - المملكة العربية السعودية - 1993 .

عنوان المرجع	**المؤلف**	**دارالنشروالسنة**
إدارة المحافظ الاستثمارية	دريد كامل آل شبيب	دار المسيرة للنشر .والتوزيع، عما ن -الأردن- 2015.
محافظ الاستثمار إدارتها واستراتيجياتها	محمد مجد الدين باكر	شعاع للنشر والعلوم حلب -سوريا- 2008.
: Principles Management of finance	Lawrence J. Gitman and Chad J. Zutter	PEARSON Education, Boston, 2015.

مراجع الدعم الإضافية (إن وجدت):

1. محمود فتوح وعمر عبد الكريم: الإدارة المالية(2)، شعاع للنشر والتوزيع، سورية -حلب- 2010.
2. منير إبراهيم هندي: أساسات الاستثمار وتحليل الأوراق المالية، المكتب العربي الحديث، الإسكندرية -مصر- 2015

التوزيع الزمني المرتقب لبرنامج المادة		
الأسبوع	**محتوى المحاضرة**	**التاريخ**
الأسبوع الأول	– المحور الأول: مدخل للأسواق المالية	
الأسبوع الثاني	– المحور الثاني: فهم المحفظة المالية. أولا: أساسيات حول المحفظة المالية. **I.** تعريف المحفظة المالية؛ **II.** المحفظة الاستثمارية والمحفظة المالية؛ **III.** أهداف المحفظة المالية؛	
الأسبوع الثالث	**(تابع)**: أساسيات حول المحفظة المالية. **IV.** أنواع المحافظ المالية.؛ **V.** قيود بناء المحفظة المالية.؛	
الأسبوع الرابع	ثانيا: إدارة المحفظة المالية **I.** تعريف إدارة المحفظة المالية. **II.** مزايا إدارة المحافظ المالية. **III.** استراتيجيات إدارة المحافظ المالية. **IV.** التحديات التي تواجه إدارة المحافظ.	
الأسبوع الخامس	– المحور الثالث: عائد ومخاطر المحفظة المالية أولا: العائد. **I.** تعريف العائد؛ **II.** أنواع العائد؛ **III.** أمثلة؛	
الأسبوع السادس	ثانيا: المخاطرة **I.** تعريف المخاطرة. **II.** أنواع مخاطر المحافظ المالية. **III.** قياس المخاطر غير النظامية.	
الأسبوع السابع	**(تابع):** المخاطرة. **IV.** قياس المخاطر النظامية. **V.** مصطلحات ذات الصلة بالمخاطرة؛ **VI.** ميولات المستثمرين تجاه المخاطر.	
الأسبوع الثامن	ثالثا: حساب عائد ومخاطر المحفظة المالية. **I.** . حساب عائد المحفظة المالية؛ **II.** حساب مخاطر المحفظة المالية.	

الأسبوع التاسع	**(تابع):** II. حساب مخاطر المحفظة المالية.	
الأسبوع العاشر	– المحور الرابع: نماذج إدارة المحافظ المالية أولا: نموذج شارب. ثانيا: نموذج ج تسعير ا لأصول الرأسمالية.	
الأسبوع الحادي عشر	ثالثا: نموذج خط سوق رأس لمال. رابعا: نموذج الترجيح.	
الأسبوع الثاني عشر	– المحور الخامس: تقييم المحافظ المالية. أولا: الأسلوب البسيط. ثانيا: الأسلوب المزدوج. **III.** نموذج ترينور: **IV.** نموذج شارب.	
الأسبوع الثالث عشر	**V.** نموذج جونسن. **VI.** نموذج فاما. **VII.**مؤشر الأداء المعدل بالمخاطرة.	

الأعمال الشخصية المقررة للمادة

1. حل تمارين خلال حصص الأعمال الموجهة؛
2. القيام بحل تمارين مقدمة على شكل واجبات منزلية؛
3. استجواب تقييمي؛

مصادقات الهيئات الإدارية والبيداغوجية

رئيس القسم	**مسؤول الميدان**	**الأستاذ مسؤول المادة**	**نائب العميد الملكف بالبيداغوجيا أو مدير الدراسات**

ملاحظة هامة: بعد المصادقة على دليل المادة في بداية كل سداسي يتم نشره على الموقع الرسمي للمؤسسة الجامعية