

نموذج وصف المقرر الدراسي: إدارة المحفظة الاستثمارية

1. أسم المقرر:	
إدارة المحفظة الاستثمارية	
2. رمز المقرر:	
WBA-42-04	
3. الفصل / السنة:	
الكورس الثاني	
4. تاريخ أعداد هذا الوصف:	
1/10/2024	
5. أشكال الحضور المتاحة:	
حضورى + الإلكتروني (عند الحاجة)	
6. عدد الساعات الدراسية (الكلية) / عدد الوحدات (الكلية) :	
3 ساعة / 3 وحدات	
7. أسم مسؤول المقرر الدراسي	
الاسم: م. د. هبة الله مصطفى السيد علي الإيميل: Hebatallah.Mu@guowa.edu.iq	
8. أهداف المقرر	
<ul style="list-style-type: none"> ✓ تعريف الطالب بأساسيات الاستثمار ، وأنواع المحافظ الاستثمارية وسياسات إدارتها. ✓ تمكين الطالب من قياس وتحليل العائد والمخاطرة للأوراق المالية (الأسهم والسندات) والمحافظ الاستثمارية. ✓ إكساب الطالب مهارة بناء المحافظ الاستثمارية المثلى من خلال تطبيق مبدأ التنويع الفعال. ✓ تدريب الطالب على استخدام نماذج التقييم المختلفة (مثل شارب، ترينور، جنسن) لقياس أداء المحافظ. ✓ فهم مفاهيم كفاءة السوق والمالية السلوكية وتأثيرها على القرارات الاستثمارية. 	أهداف المادة الدراسية
9. استراتيجيات التعليم والتعلم	
<ul style="list-style-type: none"> ✓ المحاضرات النظرية لشرح المفاهيم والنماذج المالية. ✓ جلسات حل تمارين وتطبيقات عملية لتعزيز المهارات الحسابية والتحليلية. ✓ المناقشات الصفية والحوار لتعزيز الفهم العميق للمادة. ✓ تحليل دراسات حالة عملية لفهم كيفية تطبيق النظريات في الواقع. 	الاستراتيجية
10. بنية المقرر	

الاسوع	الساعات	مخرجات التعلم المطلوبة	اسم الوحدة او الموضوع	طريقة التعلم	طريقة التقييم
1	3	فهم المفاهيم والمبادئ الأساسية للاستثمار وأنواعه.	الفصل الأول: أساسيات الاستثمار (المفهوم، المبادئ، الأنواع).	محاضرة + تمارين	مشاركة صافية
2	3	قياس العائد والمخاطرة للأصول الفردية.	الفصل الثاني: العائد والمخاطرة (المفاهيم، الأنواع، طرق الحساب).	محاضرة + تمارين	مشاركة صافية
3	3	تقييم الأسهم العادية باستخدام نماذج مختلفة.	الفصل الثالث: تقييم الأسهم العادية.	محاضرة + تمارين	واجب
4	3	تقييم السندات وفهم علاقتها بأسعار الفائدة.	الفصل الرابع: تقييم السندات.	محاضرة + تمارين	مشاركة صافية
5-6	6	فهم فرضيات كفاءة السوق وتأثير المالية السلوكية.	الفصل الخامس: كفاءة سوق رأس المال والمالية السلوكية.	محاضرة + مناقشة	امتحان يومي
7	3	قياس العائد والمخاطرة لمحفظه مكونة من أصلين أو أكثر.	الفصل السادس: قياس عائد ومخاطرة المحفظة الاستثمارية.	محاضرة + تمارين	امتحان شهري أول
8-9	6	فهم كيفية بناء المحافظ وتطبيق مبدأ التنوع لتقليل المخاطر.	الفصل السابع: بناء المحافظ الاستثمارية ومبدأ التنوع.	محاضرة + تمارين	واجب
10-12	9	تطبيق نماذج تقييم الأصول وقياس أداء المحافظ.	الفصل الثامن: نماذج تقييم الأصول وأداء المحافظ (CAPM, Sharpe, Treynor, Jensen).	محاضرة + تمارين	مشاركة صافية
13	3	تقييم شامل لفهم الطالب للمواضيع المتقدمة.	الامتحان الشهري الثاني.	امتحان إلكتروني	درجة الامتحان
14	3	تطبيق المفاهيم على حالة عملية متكاملة.	تطبيقات عملية وحالة دراسية شاملة.	دراسة حالة + نقاش	نشاط صفي
15	3	التعرف على المشتقات المالية ومراجعة المادة.	الفصل التاسع: مقدمة في المشتقات المالية ومراجعة شاملة.	محاضرة + مراجعة	أسئلة شفوية

11. تقييم المقرر

توزيع الدرجة من 100 على وفق المهام المكلف بها الطالب مثل التحضير اليومي والامتحانات اليومية والشفوية والشهرية والتحريرية والتقارير..... الخ

1. الحضور والمشاركة 10 درجات
 2. الامتحانات اليومية 10 درجات
 3. الامتحان الشهري الأول 15 درجات
 4. الامتحان الشهري الثاني 15 درجات
- الامتحان النهائي: 50 درجة
المجموع = 100 درجة

12. مصادر التعلم والتدريس

1. المومني, غازي فلاح , إدارة المحافظ الاستثمارية الحديثة, دار المناهل, 2013.
 2. محمد مطر, فايز تيم, إدارة المحافظ الاستثمارية, دار وائل, 2005.
 3. العامري, محمد علي ابراهيم , إدارة محافظ الاستثمار, دار وائل, 2013.
- Bodie, Zvi, & Kane, Marcus, Alan J., -4 Investments And Portfolio Management ,**

الكتب المقررة المطلوبة

.9th Edition, Mcgraw -Hill, USA, 2011