**مفردات مادة ادارة المحافظ الاستثمارية – المرحلة الرابعة الكورس الثاني**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **الموضوع** | **المفردات الرئيسة للموضوع** | **الاسبوع** | **ساعة** |
| **مقدمة في اساسيات الاستثمار** | 1. **مفهوم الاستثمار** 2. **مبادىء الاستثمار** 3. **انواع الاستثمارات** | **1** | **3** |
| **اساسيات العائد والمخاطرة** | 1. **مفهوم العائد** 2. **انواع العائد** 3. **حساب العائد** 4. **مفهوم المخاطرة** 5. **انواع المخاطرة** 6. **حساب المخاطرة للورقة المالية** | **2-3** | **6** |
| **تقييم العادية العادية** | 1. **مفهوم الأسهم العادية** 2. **تصنيف الأسهم العادية** 3. **مفاهيم القيمة للاسهم العادية** 4. **نماذج تقييم الأسهم العادية** | **4-5** | **6** |
| **تقييم السندات** | 1. **أساسيات السندات** 2. **أنواع السندات** 3. **آلية تقييم السندات** 4. **النظرية الكلاسيكية لأسعار الفائدة** 5. **المدة والمخاطرة** 6. **السماح بمخاطرة التخلف عن إيفاء الدين(مخاطرة الإيفاء)** | **6-7** | **6** |
| **كفاءة السوق** | 1. **مقدمة عن سوق رأس المال الكفوءة** 2. **فرضيات أشكال سوق رأس المال الكفوءة** 3. **المعلومات وسوق رأس المال الكفوءة** | **8-9** | **6** |
| **ادارة المحافظ الاستثمارية** | **مفاهيم عامة في المحفظة الاستثمارية واسس ادارتها** | **10** | **3** |
| **قاعدة التنويع في المحفظة الاستثمارية** | 1. **مفهوم التنويع** 2. **انواع واساسيات التنويع** | **11** | **3** |
| **قياس عائد ومخاطرة المحفظة** | 1. **قياس عائد المحفظة** 2. **قياس مخاطرة المحفظة** | **12-13** | **6** |
| **قياس اداء المحفظة الاستثمارية** | 1. **نموذج شارب** 2. **نموذج ترينور** 3. **نموذج جونسن** | **14** | **3** |
| **مقدمة في المحافظ الدولية** | **مفهوم ومخاطر المحافظ الاستثمارية** | **15** | **3** |
| **المجموع** | | **15 أسبوع** | **45 ساعة** |