**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** |