

عنوان الماستر: إدارة مالية Management financier

السداسي: الثالث

اسم الوحدة: الأساسية

اسم المادة: إدارة المحفظة المالية

الرصيد: 06

المعامل: 02

أهداف التعليم : تنمية قدرات الطالب المتعلقة بإدارة المحفظة المالية والاستثمار فيها.

المعارف المسبقة المطلوبة : رياضيات مالية

محتوى المادة:

1. الاستثمار في المحفظة المالية

✓ العائد والمخاطرة في الاستثمارات الفردية

✓ العائد والمخاطرة في المحفظة

✓ التنويع الأمثل ونظرية Markowitz

✓ منحني الاستثمارات المثلى

2. نماذج تسعير الأصول المالية

✓ العلاقة بين العلاقة بين العائد والمخاطرة في المحفظة

✓ نموذج شارب والعلاقة بين العائد والمخاطرة في الاستثمار الفردي واستثمار السوق.

✓ نماذج أخرى لتسعير الأصول المالية.

3. صناديق الاستثمار

✓ تاريخ ونشأة صناديق الاستثمار.

✓ استراتيجية بناء المحافظ المالية

✓ نماذج تقييم المحافظ الاستثمارية.

طريقة التقييم: تقييم مستمر ونهائي

المراجع:

1. السيد عليوه، تحليل مخاطر الاستثمار، دار الأمين، القاهرة، 2006.

2. إيهاب الدسوقي، اقتصاديات كفاءة البورصة، دار النهضة العربية، القاهرة، 2000

3. خالد وهيب الراوي، إدارة المخاطر المالية، دار المسيرة، الأردن، 2003

4. جلال إبراهيم العبد، تحليل وتقييم الأوراق المالية، الدار الجامعية، الطبعة الأولى، 2003.

5. محمود أمين زويل، بورصة الأوراق المالية، دار الوفاء، مصر، 2000.

6. محمود محمد الداغر، **الأسواق المالية**، دار الشروق، الأردن، الطبعة الأولى، 2005

7. Pascale Viala et Eric Briys, **Elément de Théorie Financière**, NATHAN, France, 1995
8. Robert Goffin, **Principe de Finance Moderne**, Economica, Paris, 3^{ème} édition.
9. D. Szpiro, **Économie Monétaire et Financière**, de Boeck, 2009
- 10.D. Szpiro, **Introduction à la Finance de Marché**, Economica, 1997
- 11.Philippe Gillet, **l'efficience des marchés financiers**, Economica, Paris, 2^{ème} Edition, 2006