**نموذج وصف المقرر**

**وصف المقرر**

|  |
| --- |
| يتضمن المقرر مدخل الي المحافظ الاستثمارية ويشمل المحفظة المالية والاستثمارية المفهوم والانواع و و أدوات الاستثمار و اساسيات المحافظ الاستثمارية والعائد والمخاطرة ونظريات المحفظة الاستثمارية وتخصيص الاصول وتنويع الاصول وبناء المحفظة الاستثمارية واسترتجيات المحفظة الاستثمارية والعوامل المؤثرة في متغيرات المحفظة الاستثمارية واهم استراتجيات المحفظة الاستثمارية و الاتجاهات الحدسثة في إدارة محافظ الاستثمار . |

|  |  |
| --- | --- |
| 1. المؤسسة التعليمية | كلية الإدارة والاقتصاد – جامعة ذي قار |
| 1. القسم العلمي / المركز | قسم العلوم المالية والمصرفية |
| 1. اسم / رمز المقرر | محافظ استثمارية |
| 1. أشكال الحضور المتاحة | الكتروني |
| 1. الفصل / السنة | الفصل الاول / المرحلة الرابعة |
| 1. عدد الساعات الدراسية (الكلي) | 45 ساعة |
| 1. تاريخ إعداد هذا الوصف | 2021 |
| 1. أهداف المقرر | |
| التعرف على مفهوم الاستثمار والمحافظ الاستثمارية وانواعها وسياسات ادارتها | |
| التعرف على طرق قياس العوائد وتقييمها , وأمثلة عملية حول ادارة المحافظ كافة . | |
| أن يتعرف الطالب على تحليل العائد والمخاطر التى تتعرض لها المحافظ الاستثمارية | |
| التعرف على مقاييس ونماذج تقييم أداء مدراء المحافظ | |
| ان يتعرف على النظريات المختلفة للمحافظ الاستثمارية والمبادئ التى يقوم عليها نموذج تسعير الاصول الرأسمالية (CAPM) | |
| أن يتم تركيز الطالب على الكيفية التى يتم بها إختيار الاصول وتصميم المحفظة . | |

|  |
| --- |
| 1. مخرجات المقرر وطرائق التعليم والتعلم والتقييم |
| أ- الأهداف المعرفية  أ1- التعرف على مفهوم الاستثمار والمحافظ الاستثمارية وانواعها وسياسات ادارتها  أ2- معرفة تطور المحافظ الاستثمارية  أ3- معرفة وظائف المحافظ  أ4- معرفة اهمية المحافظ وأدواتها  أ5- المام الطالب بكيفية توزيع الاستثمارات المختلفة على المحافظ الاستثمارية وتقويم أدائها أ6- التعرف على طرق قياس العوائد وتقييمها , وأمثلة عملية حول ادارة المحافظ كافة .  أ7- أن يتعرف الطالب على تحليل العائد والمخاطر التى تتعرض لها المحافظ الاستثمارية  أ8- ان يتعرف على النظريات المختلفة للمحافظ الاستثمارية والمبادئ التى يقوم عليها نموذج تسعير الاصول الرأسمالية (CAPM) . |
| ب - الأهداف المهاراتية الخاصة بالمقرر.  ب1 - ان يدرس الطالب مواضيع سابقة  ب2- الاطلاع على بعض مصادر المحافظ الاستثمارية  ب3 -  ب4- |
| طرائق التعليم والتعلم |
| * اعطاء واجبات للطلاب كتحضير قبل موعد المحاضرة * مشاركة الطلاب في النقاش و طرح الاسئلة * مساعدة الطلاب على النقد البناء و ابداء الرأي مع احترام اراء زملائه الطلاب . |
| طرائق التقييم |
| * المشاركات اليومية و طبيعة الاسئلة التي تثار في المحاضرة. * الاختبارات التحريرية والشفوية * تقييم الواجبات المنزلية |
| ج- الأهداف الوجدانية والقيمية  ج1- الاطلاع على الجانب النظري للمقرر .  ج2- تقييم الواقع و الاستفادة من التجارب المختلفة بما يخص المحافظ الاستثمارية. |
| طرائق التعليم والتعلم |
| * تقديم المادة العلمية على شكل pdf . * تحليل العوائد والمخاطر لأحدى الشركات الاستثمارية المتداولة في سوق العراق للأوراق المالية من اجل تقييم واقعها العملي . * التعرف على بعض التجارب المحلية والدولية في مجال الاستثمار من خلال تشكيل محافظ استثمارية او مالية . |
| طرائق التقييم |
|  |
| د - المهارات العامة والتأهيلية المنقولة ( المهارات الأخرى المتعلقة بقابلية التوظيف والتطور الشخصي ).  د1- مهارة تحمل المسؤولية من خلال في عمل ضمن مجموعة صغيرة لتقييم وضع مالي معين لاحد الشركات الاستثمارية من خلال العائد والمخاطرة للأسهم المصدرة من قبلها .  د2- تنزيل المادة العلمية من خلال تطبيق ( Google Classroom) .  د3- استخدام شبكة التواصل الاجتماعي لمناقشة موضوعات المقرر .  د4- إدارة مجموعات تواصل اجتماعي . |
| طرائق التعليم والتعلم |
| * تكليف الطالب بتشكيل مجموعات عمل وتعيين قائد لكل منها . * تكليف الطالب بتنزيل محتوى المقرر من رابط الصف بتطبيق ( Google Classroom) . * تكليف الطالب بالمشاركة في مجموعة او قناة على التليكرام الخاصة بالمقرر . * تكليف أحد الطالب (ممثل المرحلة ) بإدارة المجموعة او القناة دوريا . |
| 1. طرائق التقييم |
| * مشاركات في قاعة الدراسة وتدخل ضمن درجة السعي من التقييم النهائي * المشاركة الفاعلة في مجموعة او القناة الخاصة للمقرر على التليكرام * تدخل ضمن درجة السعي من التقييم النهائي . |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1. بنية المقرر | | | | | |
| الأسبوع | الساعات | مخرجات التعلم المطلوبة | اسم الوحدة / أو الموضوع | طريقة التعليم | طريقة التقييم |
| 1 | 3 |  | مقدمة في المحافظ الاستثمارية مفهوم , ونشاه , اهمية , واهداف  انواع المحافظ الاستثمارية والعوامل المؤثرة به |  |  |
| 2 | 3 |  | مفهوم العائد وقياسه , معدل العائد المتوقع , المخاطر |  |  |
| 3 | 3 |  | قياس العائد المحفظة , مخاطرة الموجود الفردي |  |  |
| 4 | 3 |  | الانحراف المعياري , التباين , معامل الاختلاف, بيتا المخاطر النظامية |  |  |
| 5 | 3 |  | قياس العائد والمخاطر في المحفظة تعريف وقياس المخاطر, |  |  |
| 6 | 3 |  | نظرية المحفظة الاستثمارية ومكوناتها |  |  |
| 7 | 3 |  | ادارة المحفظة الاستثمارية , قرارات المحافظ الاستثمارية قرار المزج او التنويع |  |  |
| 8 | 3 |  | نماذج المحافظ الاستثمارية خط سوق راس المال, نموذج تسعير الاصول الراسمالية |  |  |
| 9 | 3 |  | امتحان الشهر الاول |  |  |
| 10 | 3 |  | نماذج المحافظ الاستثمارية خط سوق راس المال, نموذج تسعير الاصول الراسمالية , |  |  |
| 11 | 3 |  | تحليل المحفظة الاستثمارية, تنويع المحفظة الاستثمارية , معامل الارتباط , حساب عائد المحفظة في اختلاف العوائد, المحفظة الاستثمارية المثلى |  |  |
| 12 | 3 |  | تقييم اداء المحافظ الاستثمارية , نموذج شارب لتقييم اداء المحفظة , نموذج ترينور لتقييم اداء المحفظة , نموذج جنسن لقياس اداء المحفظة , |  |  |
| 13 | 3 |  | تحليل بيئة الاستثمارات في المحفظة الاستثمارية , انواع الاسواق المالية , الادوات المالية في سوق راس المال, التحليل الاساسي والفني للادوات الاستثمارية |  |  |
| 14 | 3 |  | ادارة محافظ صناديق الاستثمار |  |  |
| 15 | 3 |  | الامتحان الشهر الثاني |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| 1. البنية التحتية | |
| 1ـ الكتب المقررة المطلوبة |  |
| 2ـ المراجع الرئيسية (المصادر) | كتاب ادارة محافظ الاستثمار / الاستاذ الدكتور محمد علي ابراهيم العامري / جامعة بغداد / الطبعة الاولى / 2013 |
| اـ الكتب والمراجع التي يوصى بها ( المجلات العلمية , التقارير ,.... ) | (المجلات العلمية، التقارير،...الخ) (أرفق قائمة بها) هندى ، منير ابراهيم (٢٠٠٧ ، (إدارة المحافظ الاشتثمارية: مدخل تحليلي عاصر،القاهرة ، دار النهضة العربية |
| ب ـ المراجع الالكترونية, مواقع الانترنيت .... |  |

|  |
| --- |
| 1. خطة تطوير المقرر الدراسي |
| 1. استراتيجيات الحصول على التغذية الراجعة من الطالب بخصوص فعالية التدريس .  * التواصل عن طريق البريد االكترونى لتقويم برامج الطالب. * التقييم الطالبي للمقرر وأستاذ المادة من خلال موقع الجامعة العلمي.  1. استراتيجيات أخرى لتقويم عملية التدريس من قبل الأستاذ أو القسم .  * المراجعة الدورية للمقرر من قبل لجنة القسم . * تدوير المقررات . * التقييم من قبل أستاذ خارجي . * المراجعة الداخلية لتقرير المقرر ومناقشة نقاط القوة والضعف وطرق التحسين من خلال مجلس القسم العلمي.  1. إجراءات تطوير التدريس .  * تشجيع عمليات التعلم الذاتى * تشجيع استخدام التقنية الحديثة فى تقديم المقرر الدراسى . * تشجيع الطالب على التقديم والالقاء . * تشجيع الطالب على المناقثشات الجماعية. * عقد لقاءات دورية من أجل تطوير التدريس من واقع نتائج التغذية الراجعة من الطالب . |

مدرس المادة

م.م. سهير كاظم عبد الكريم