

ملحق رقم 2 (هـ)

المملكة العربية السعودية  
وزارة التعليم العالي  
جامعة أم القرى  
كلية العلوم الاقتصادية والمالية الإسلامية

قسم المصارف والاسواق المالية

توصيف المقرر

اسم المقرر : ادارة المحافظ الاستثمارية

الرمز : 3-63023302

المستوى الدراسي : السادس

العام الدراسي

1437/1436 هـ

2015-2016 م

### نموذج توصيف المقرر

المؤسسة التعليمية:	تاريخ التقرير: 1437/1/10
الكلية: كلية العلوم الاقتصادية والمالية الإسلامية	: المصارف والاسواق المالية

#### أ. تحديد المقرر ومعلومات عامة عنه

.	:	الاستثمارية	3-63023302
.	:	3:	
. البرنامج أو البرامج التي يتم تقديم المقرر ضمنها (إذا كان المقرر يُقدم كمادة اختيارية ضمن برامج متعددة، يرجى الإشارة ): بكالوريوس المصارف والأسواق المالية			
. اسم عضو هيئة التدريس المسؤول عن تدريس : . فهد الشريف			
. المستوى أو السنة التي يُقدم فيها هذه المقرر:			
. المتطلب السابق لهذه المقرر ( ) : (الأسواق المالية 2-63023301			
. المتطلب المصاحب لهذه المقرر ( ) : لا يوجد			
. تدريس المقرر إن لم يكن في المقر الرئيسي للمؤسسة التعليمية:			
. أنماط التعليم ( ) ✓ :			
الفصل الدراسي التقليدي	<input checked="" type="checkbox"/>	النسبة الم	100%
. التعليم المدمج (التقليدي والإلكتروني )	<input type="checkbox"/>	النسبة الم	<input type="checkbox"/>
. التعليم عن	<input type="checkbox"/>	النسبة الم	<input type="checkbox"/>
.	<input type="checkbox"/>	النسبة الم	<input type="checkbox"/>
هـ.	<input type="checkbox"/>	النسبة الم	<input type="checkbox"/>
ملاحظات:			

ب. الأهداف

. ما الهدف الرئيس لهذا المقرر؟

- 1- أن يتعرف الطالب من خلال دراسته لهذا المقرر على تقييم المحفظة الاستثمارية
- 2- ان يتعرف الطالب على الكيفية التي يتم بها إختيار الاصول وتصميم المحفظة
- 3- أن يتعرف الطالب على تحليل العائد والمخاطر التي تتعرض لها المحافظ الاستثمارية
- 4- ان يتعرف على النظريات المختلفة للمحافظ الاستثمارية والمبادئ التي يقوم عليها نموذج تسعير الاصول ال أرسلمالية

. يتم تنفيذها لتطوير وتحسين المقرر. ( ) : زيادة استخدام المراجع التي تعتمد على تكنولوجيا المعلومات أو شبكة الانترنت، أو تغييرات في محتوى المقرر بناءً على بحوث علمية جديدة في المجال العلمي

المقرر هو ضمن برنامج جديد لقسم المصارف والأسواق المالية ، وليس هناك حالياً بطبيعة الحال خطط يتم تنفيذها لتطوير المقرر.

ج. وصف المقرر

. ( ) : ينبغي إرفاق الوصف العام كما يظهر في دليل أو نشرة البرنامج):

يشرح هذا المقرر الخلفية النظرية والعملية في تكوين محافظ الاستثمار في الأوراق المالية وإدارتها وأساليب تقييمها ، حيث يتعرض هذا المقرر لمفهوم المحفظة المثلى والمحفظة المتنوعة ونظرية المحفظة ونماذج التسعير المستخدمة في أسواق المال ، بالإضافة إلى عوامل نجاح تنوع المحافظ الاستثمارية وكيفية قياس مخاطرها وتقدير عوائدها

. قائمة الموضوعات التي ينبغي تغطيتها:

ساعات التدريس	عدد الأسابيع	قائمة المواضيع
3	1	مفهوم السوق المالي ووظائفه والأسواق الفرعية العاملة فيه ومؤسساته
3	1	العلاقة بين أسعار الأصول المالية والقيمة الحالية للعوائد المتوقعة من ورائها ( )
6	2	( ) : ( ) الفائدة الحقيقي وسعر الفائدة ( ) العلاقة بين أسعار الفائدة السوقية وأسعار السندات السوقية ( ) الهيكل الزمني لسعر الفائدة
6	2	طرق اصدار الأصول المالية: ( ) ر الأسهم ( )
6	2	المالية ( ) ( ) ( ) التنوع تدنية

6	2	<p>محفظة الأصول المالية : تحليل الطلب على الأصول المالية ( ) المالية ( ) كفاءة الأسواق المالية في تخصيص الموارد (فرضية السوق الكفؤ) ( ) (نموذج تسعير الأصل ، نموذج التسعير</p>
6	2	<p>تطبيقات الاستثمارية:- ( ) المالية وتكوين الاستثمارية ( ) السلبية الاستثمارية</p>
6	2	<p>الهيكل التمويلي ( ) التمويل . ( ) للتمويل ( ) للتمويل ( ) مودجلياني - ميلر- التمويل بالدين</p>
3	1	
45	15	

. (مجموع ساعات التدريس الفعلية والساعات)						
30:(						
				الإضافية		
45	--	--	--	--	45	التدريس الفعلية
3	--	--	--	--	3	

3

. ساعات المذاكرة أو التعلم الإضافية المتوقعة من الطالب في الأسبوع

. مخرجات التعلم للمقرر حسب مجالات التعلم وفق الإطار الوطني للمؤهلات وموائمتها مع طرق التقويم واستراتيجيات التدريس.

تعمل كل من مخرجات التعلم للمقرر وطرق التقويم واستراتيجيات التدريس مع بعضها البعض في منظومة موحدة بين تعلم الطلاب، والتقويم، والتدريس.  
يوفر الإطار الوطني للمؤهلات خمس مجالات للتعلم، ينبغي تحديد مخرجات تعلم للمقرر، وعادةً لا يجب أن يتعدى عدد مخرجات التعلم للمقرر الواحد ثمانية مخرجات تكون متوائمة مع مجال أو أكثر من مجالات التعلم الخمسة.  
مقررات الدراسية مخرج واحد أو أكثر للبرنامج مدمجة مع مخرجات التعلم للمقرر وذلك لإظهار الموائمة بين . تحدد مصفوفة تخطيط مخرجات تعلم البرنامج أي من مخرجات التعلم

للبرنامج مدمجة مع مقررات دراسية معينة.

الي تم إدراج مجالات التعلم الخمسة وفق الإطار الوطني للمؤهلات مرقمة في العمود الأيمن.

**يرجى التقيد بالخطوات التالية عند تعبئة الجدول:**

**أولاً:** أدرج مخرجات التعلم المناسبة والقابلة للقياس والمطلوب تحققها في مجالات التعلم الملائمة ( **ثانياً:** أدرج استراتيجيات التدريس المساندة المتلائمة مع طرق التقويم ومخرجات التعلم المرجوة. **ثالثاً:** أدرج طرق التقويم المناسبة والتي تقيس وتقيم مخرج التعلم بدقة. ينبغي لكل مخرج من مخرجات التعلم للمقرر وكل طريقة تقويم وكل إستراتيجية تدريس أن تتناغم سوياً وبشكل منطقي كعملية تعلم وتعليم متكاملة. **رابعاً:** في حال إدراج أي مخرجات تعلم للبرنامج العلمي ضمن مخرجات التعلم للمقرر الدراسي يرجى وضع علامة \*

ليس بالضرورة أن يتضمن كل مقرر دراسي مخرجات تعلم من كل مجال من مجالات التعلم.

أساليب التقويم المستخدمة في المقرر	استراتيجيات تدريس المقرر	مجالات التعلم وفق الإطار الوطني للمؤهلات ومخرجات التعلم للمقرر	
		المعرفة	٠.١
		يتعرف الطالب على كيفية تعبئة الموارد التمويلية وتوزيعها من خلال الأسواق المالية .	٠
		يتعرف الطالب على كيفية تحديد أسعار الأصول المالية المباشرة : الأسهم والسندات .	٠
		يتعرف الطالب على الوظائف الحيوية للوسطاء الماليين.	٠
		يتعرف وسعر الفائدة الحقيقي .	٠
		يتعرف الطالب على أنواع المخاطر وتقسيماتها وطرق تخفيضها .	٠
		يتعرف الطالب على الأصول المالية والعلاقة بين المخاطر والعائد، والعلاقة بين مخاطر الأصل المالي ومخاطر المحفظة التي يدخل فيها.	٠
		يتعرف الطالب على وافتراضاته ومدى تحققه في الواقع.	٠
		يتعرف الطالب على معامل بيتا ، كعلاقة بين	٠
		يتعرف الطالب على الهيكل التمويلي ومعدل	٠
		يتعرف الطالب على صافي القيمة الحالية ومعدل العائد الداخلي وعلاقتها بسعر الخصم	٠
		المهارات الإدراكية	٠.٢
		يُفسر الطالب نتائج التحليل للمحافظ الاستثمارية وماتحويه من عائد ومخاطر.	٠
		يُخطط الطالب للاختيار بين الاستثمارات المثلى وماهو الاستثمار الكفاء.	٠
		يُفسر الطالب المبادئ التي يقوم عليها نموذج تسعير الاصول	٠
		مهارات التعامل مع الأشخاص وتحمل المسؤولية	٠.٣
		يختار الحوار الايجابي	٠
		يستخدم النقد الذاتي	٠
		يقدر التعاون مع الزملاء ويستمع للآخرين بايجابية	٠
		مهارات الاتصال وتقنية المعلومات والمهارات الحاسوبية	٠.٤
		يثبت القدرة على التعامل مع الكمبيوتر في إعداد عروض تقديمية ( البوربوينت )	٠

التقويم الذاتي . تقويم الزملاء	تشجيع الطلبة على تقديم العروض باستخدام البوربوينت المناقشات بين الطلبة -	يثبت المهارة في استخدام البريد الالكتروني في عرض الاعمال والانشطة المطلوبة على أستاذ المقرر وتلقى الملاحظات -يثبت القدرة على التواصل الكتابي الجيد .	
		المهارات النفس حركية	٥ .
لا ينطبق	لا ينطبق	لا ينطبق	.

الأفعال المستخدمة في صياغة مخرجات التعلم وفق الإطار الوطني للمؤهلات، واقترحات حول طرق التقويم واستراتيجيات التدريس	
مجالات التعلم وفق الإطار الوطني للمؤهلات	الأفعال المقترحة
المعرفة	يُعدّد، يُسمّي، يُسجّل، يُعرّف، يضع إسماء، يستعرض، يذكر، يصف، يتذكّر، يحفظ، ينسخ، يتعرّف على، يُخبر، يكتب
المهارات الإدراكية	يُقدّر، يشرح، يُلخص، يكتب، يُقارن، يُفرّق، يُمثّل برسم بياني، يُقسّم الى فروع، يُفرّق بين، ينتقد، يحسب، يُحلل، يُولف، يُطور، يُنشئ، يُعد، يُعيد بناء، يُعيد ترتيب، يشرح، يتنبأ، يُبرّر، يُقيّم، يُقدّر، يُخطّط، يُصمّم، يقيس، يحكم على، يُفسّر، يُحمن
مهارات التعامل مع الأشخاص وتحمل المسؤولية	يُثبت، يحكم، يختار، يُوضّح، يُعدّل أو يُغيّر، يُبين، يستخدم، يُقدّر، يُقيّم، يُبرّر، يُحلل، يتساءل، يكتب
مهارات الاتصال وتقنية المعلومات والمهارات الحسابية	يُثبت، يحسب، يُوضّح، يُفسّر، يبحث، يتساءل، يُشغّل، يُقدّر، يُقيّم، ينتقد
المهارات النفس حركية	يُثبت، يُظهر، يُوضّح، يُؤدي، يُعبّر بطريقة مسرحية درامية، يُوظف مهارات أو أدوات، يتلاعب، يُشغّل، يُعد، يُنتج، يرسم، يُمثّل برسم بياني، يتفحص، يبني أو يُشكّل، يُركب، يُجرب، يُعيد بناء

الأفعال التي يُقترح عدم استخدامها	كتابة مخرجات التعلم التي يمكن قياسها وتقييمها.
يعتبر يفهم يحافظ أو يبقي يُعمّق	يُضخم أو يزيد يكمل يُراجع يُكبر
يعكس	يفحص يُقوي يسكتشف يُشجع

يمكن استخدام بعض هذه الأفعال اذا كانت ذات علاقة بأعمال أو مقاييس معينة.

**طرق التقويم و استراتيجيات التدريس المقترحة هي:**  
استخدام طرق متعددة ومستمرة للتحقق من تعلم الطلاب، وتشمل التوجهات  
الحالية مجموعة واسعة من أدوات التقييم باستخدام سلم التقدير اللفظي (Rubrics) من ضمنها أنظمة قياس أداء الطالب على  
الشبكة العنكبوتية والتي تستخدم سلم التقدير اللفظي (Rubrics) والمقارنات المعيارية (Benchmarks)  
الرئيسية (KPIs) والتحليل، ويعتبر سلم التقدير اللفظي (Rubrics) مفيد بشكل خاص في التقييم النوعي (Qualitative Evaluation).  
أما استراتيجيات التقييم المراعية والمبينة للفروقات فتشمل ما يلي: الاختبارات، ملف الطالب، المقالات الطويلة  
والقصيرة، دفاتر المتابعة أو سجلات التعلم، التقارير التحليلية، العروض الفردية والجماعية، الملصقات، اليوميات، دراسة  
الحالة، مذكرة معلم، تحليل فيديو، التقارير الجماعية، تقرير معلم، المناظرات، الخطب، سجلات التعلم (Learning Logs)  
تقييم الزملاء، التقييم الذاتي، عمل فيديو، عمل رسومات، الأداء الدرامي، عمل جداول، العروض التوضيحية، المنظمات  
البصرية (Graphic Organizers)، منتديات النقاش، المقابلات، عقود التعلم (Learning Contracts) (Anecdotal Notes)، الأعمال الفنية، جداول التعلم (KWL) (ماذا أعرف؟ ماذا أريد أن أعرف؟ ماذا  
(، خرائط المفاهيم.

يجب اختيار استراتيجيات التدريس المراعية للفروقات بحيث تتناسب مع محتوى المقرر الدراسي واحتياجات الطلاب  
ات صغيرة، المناقشة  
تشمل استراتيجيات التدريس ما يلي:  
مع الفصل بشكل عام أو في مجموعات نقاش صغيرة، النشاطات البحثية، الشرح العملي في المعمل، المشاريع، المناظرات،  
لعب الأدوار، دراسة الحالة، الاستعانة بضيف متحدث، الحفظ، الفكاهة، تقديم العروض الفردية، العصف الذهني، ومجموعة  
التعلم العملية.

. جدول المهام والتكاليف التي يتم فيها تقييم الطلبة خلال الفصل الدراسي

النسبة من التقييم النهائي	موعد تسليم المهمة أو التكليف	مهمة التقويم ( : فصلي، خطبة، عرض شفهي، ... )	
10%		الواجبات	أ.
10%		مشاركة في المحاضرات	ب.
10%	الأسبوع السادس	امتحان دوري أول	ج.
10%	الأسبوع الحادي عشر	امتحان دوري ثاني	د.
60%	وفقاً للتقويم الأكاديمي	امتحان نهائي	هـ.



د. الإرشاد الأكاديمي والدعم المقدم للطلبة:

. ترتيبات تواجد أعضاء هيئة التدريس ومن في حكمهم لتقديم المشورة والإرشاد الأكاديمي الفردي للطلاب. ( الزمنية المتوقع تواجد أعضاء هيئة التدريس خلالها في الأسبوع)

**ساعتان أسبوعياً في المكتب  
التواصل المستمر عن طريق البريد الإلكتروني**

هـ. مصادر التعلم:

1. -1	:	الاستثمارية، المناهج والتوزيع،
. قائمة المراجع المساندة الأساسية (الدوريات العلمية، التقارير، ...):		
<b>1- Scott B. Smart and William L., Megginson " Introduction to financial management " 2nd., edit., South Western : 2007.</b>		
<b>2- Robert A. Haugen , " Modern investment theory " , 4th., Prentice-Hall: 1977.</b>		
. هندی منيرا هيم		
: (الدوريات العلمية، التقارير، ...):		
الاستثمارية : تحليلي معاصر، القاهرة النهضة العربية		
. قائمة المصادر الإلكترونية ( ) :		
<b>http://www.sama.gov.sa :</b>		
<b>هيئة السوق المالية : http://www.cma.org.sa</b>		
. مواد تعلم أخرى مثل البرامج التي تعتمد على الكمبيوتر أو الأقراص المضغوطة أو المعايير أو اللوائح المهنية أو الأنظمة البرمجية:		

و. المرافق والتجهيزات المطلوبة

حدد احتياجات المقرر بما في ذلك حجم الفصول الدراسية والمعامل ( ) : عدد المقاعد في الفصول الدراسية والمعامل، مدى توافر أجهزة الكمبيوتر، ... ) .	
. المرافق التعليمية ( ) : فصول دراسية، معامل، قاعات العرض أو معامل الإيضاح، ... ) : <b>قاعة دراسية كافية لعدد الطلاب المسجلين</b>	
. التجهيزات الحاسوبية ( ) : أجهزة الصوت والصورة (AV)، أجهزة العرض، السبورات الذكية، برامج الكمبيوتر، ... ) : <b>الحاسبات الآلية الشخصية لدى الطلاب</b>	
<b>Excel , Portfolio analysis</b>	
. ( ) : إذا كان مطلوباً معدات مختبر معينة حدد الاحتياجات أو أرفق قائمة:	

ز. تقييم المقرر وعمليات التحسين:

. استراتيجيات الحصول على التغذية الراجعة من الطلاب حول فعالية عملية التدريس:  
**التقييم الطلابي عن طريق موقع الجامعة ( استبانة تقييم )**

. استراتيجيات أخرى لتقييم عملية التدريس من قِبَل المدرس في القسم أو في البرنامج:

**متابعة نتائج الطلاب خلال عدة فصول دراسية**  
**استقبال ملاحظات الطلاب عن طريق اللقاءات الدورية**

. عمليات تحسين التدريس:

**حضور دورات تدريبية عن أساليب التعليم**

**استضافة بعض المتخصصين في بعض اللقاءات**

. عمليات التحقق من مستويات إنجاز الطلبة ( :مراجعة التصحيح من قبل عضو هيئة تدريس مستقل لعينة من أعمال الطلبة، أو تبادل تصحيح الاختبارات أو عينة من الواجبات بصفة دورية مع عضو هيئة تدريس في مؤسسة تعليمية أخرى):  
**لا يوجد**

. صف ترتيبات التخطيط

. صف ترتيبات التخطيط

**التقويم الدوري للمقرر .**

**( ) لتطوير المقرر .**

عضو هيئة التدريس ومن في حكمه: \_\_\_\_\_

التوقيع: \_\_\_\_\_ تاريخ إكمال التقرير: **1437/1/10**

عميد/ رئيس القسم: **المصارف و الاسواق المالية**

التاريخ: **1437/1/11**

تم استلام التقرير من قِبَل: **أ.د. فهد الشريف**

التوقيع: \_\_\_\_\_