



(1207413)Portfolio Management (3 Cr)

This course combines an advanced analysis of the modern theory of portfolio selection and management, with a thorough examination of the current capital market theory. The module, therefore, covers the risk and project appraisal, portfolio theory, the capital asset pricing model and the arbitrage pricing theory. On the managerial side, however, the module explores portfolio performance evaluation, international diversification, the process of portfolio management, and the theory of active portfolio management.

(2107413) تحليل المحافظ الاستثمارية(3 ساعات معتمدة)

تقوم هذه المادة على شرح ضرورة عملية اتخاذ قرارات الاستثمار بشكل عقلاني من خلال إدخال عامل المخاطرة و استخدام أساليب تحليل المخاطر المختلفة في ذلك لذا فهي تنطرق إلى شرح العلاقة التبادلية بين العائد ومخاطر المحفظة وصولاً إلى فهم خصائص تعدد عناصر المحفظة و توضيح النظرية التي تقف وراء كل من نماذج تسعير الأصول الرأسمالية Capital Asset Pricing Model و Arbitrage Pricing Theory (APT) و خصائص كل منهما. تسعى المادة أيضاً لإكساب مهارة تحديد المحفظة الكفوءة، تطبيق نظرية المنفعة، وتحديد المحفظة المثلى. تتضمن المادة أيضاً البحث في إدارة المحفظة الفعالة من خلال التطرق إلى تقييم أداء المحفظة الفعالة، تنوع الاستثمارات على المستوى الدولي، خطوات إدارة المحفظة الفعالة، و نظرية إدارة المحفظة الفعالة.