

وصف المقرر

الاعمال		الكلية
7(4)	NQF level	العلوم المالية و المصرفية
الاسواق المالية و النقدية	متطلب سابق	اسم المقرر
	304441	الأدوات المالية والمشتقات
	عملي	الساعات المعتمدة
	***	3
	نظري	منسق المقرر
	الايمل	د.فادي الشناق
	الايملات	د.فادي الشناق
	المكان	وقت المحاضرة
	مبنى كلية الاعمال C205	الساعات المكتبية
	تاريخ التعديل	الفصل الدراسي
10/2021	11/2020	الاول 2021/2022
دوام كامل (وجاهي)	شكل الحضور	الشهادة
		بكالوريوس العلوم المالية و المصرفية

وصف المقرر المختصر

يتناول هذا المساق التعريف بمفهوم واهداف الهندسة المالية، مجالات الهندسة المالية وفلسفتها واستراتيجياتها، وادوات ومنتجات الهندسة المالية ، استخدام وتقييم العقود المستقبلية ، العقود الآجلة، المبادلات، الخيارات ،كما يتناول طرق تسعير الخيارات بأساليبها المختلفة مثل نموذج بينوميال مودل لمرحلة واحد ولمرحلتين (محفظة التحوط)، نموذج بلاك اند شولز، فهم إستراتيجيات الخيارات البسيطة والمتقدمة مثل: إستراتيجية الثنائية، إستراتيجية الخنق، إستراتيجية الدب والثور، إستراتيجية الفراشة، إستراتيجية النسر الأمريكي، إستراتيجية الطوق.

اهداف المقرر

1. التعرف الى فلسفة الهندسة المالية
2. تعميق فهم الطالب بأدوات الهندسة المالية
3. التعرف الى أنواع الهندسة المالية
4. فوائد تطبيق الخيارات والعقود الآجلة والمستقبلية
5. التعرف الى بعض المفاهيم المتعلقة بالخيارات المالية

مخرجات التعلم
<p>A. المعرفة -الفهم النظري عند اكمال متطلبات المقرر،سيتمكن الخريج من:</p> <p>a 1 . يفهم عمل اسواق المشتقات المالية وأنواع العقود المتداولة فيها بشكل تفصيلي.</p>
<p>B -المعرفة -التطبيق العملي عند اكمال متطلبات البرنامج، سيتمكن الخريج من:</p> <p>a 2 . يطبق نماذج متعددة لتسعير الخيارات بأنواعها المختلفة والقدرة على التنبؤ بالمخاطر المالية.</p>
<p>C. مهارات -الحل العام للمشكلات و المهارات التحليلية عند اكمال متطلبات البرنامج، سيتمكن الخريج من:</p> <p>b1 . يحلل استراتيجيات الخيارات التي تمكنه من أن يصبح مستثمر مضارب او مراجح .</p>
<p>D. مهارات -الاتصالات وتكنولوجيا المعلومات والاتصالات والحسابات عند اكمال متطلبات البرنامج، سيتمكن الخريج من:</p> <p>b2 . يكتسب القدرة على التنبؤ بأسعار الأدوات المالية محل التعاقد.</p>
<p>E. الكفايات: الحكم الذاتي والمسؤولية والسياق عند اكمال متطلبات البرنامج، سيتمكن الخريج من:</p> <p>c1 . يصمم محفظة استثمارية مكونة من اوراق مالية تناسب مع اتجاهات سوق المشتقات.</p>
<p>طرق التعلم والتعليم</p> <p>١ . المحاضرة. ٢ . النقاش مع الطلاب وطرح الأسئلة. ٣ . العروض التقديمية وإشراك الطلاب في المحاضرة وتوجيه الطالب المقدم للعرض التقديمي بطرح اسئلة استنتاجية على الطلاب وإثراء النقاش بينهم. ٤ . إشراك الطلاب في حل المسائل ورسم الاستراتيجيات. ٥ . استخدام اسلوب حل المشكلات ومحاكاة الواقع من خلال افتراض ان الطلاب يعملون كمحللين ماليين أو مستثمرين. ٦ . طرق التعلم الذاتي وعن البعد</p>
<p>طرق التقييم</p>

الامتحانات القصيرة، الامتحانات الفصلية، تقييم تفاعل الطالب داخل المحاضرة، واجبات، عرض تقديمي من الطالب، امتحانات نهائية.

محتوى المقرر					
سبوع	ساعات	مخرجات	المواضيع	طرق التعلم والتعليم	طرق التقييم
1	3	a1	المشتقات المالية، مفاهيم، أنواع عقود المشتقات، أهدافها، المتعاملون بها، الانتقادات الموجهة لها، مخاطر التعامل بها.	المحاضرة، نقاش مفتوح، عرض تقديمي	امتحان قصير، واجبات، امتحان فصلي، عرض تقديمي
2	3	a1	الخيارات، مفهومها، خيار الشراء، خيار البيع، سعر التنفيذ، تاريخ التنفيذ، الأدوات المالية محل التعاقد، الية التداول، الفرق بين السوق المنظم وغير المنظم.	عرض تقديمي، محاضرات، نقاش مفتوح	واجبات، امتحانات فصلية، عرض تقديمي
3	3	a2	أساسيات التسعير، القيمة الذاتية لخيارات الشراء والبيع، سعر خيار الشراء والبيع، العوامل المؤثرة في سعر التنفيذ.	محاضرات، حل مسائل عملية	امتحان فصلي، واجبات
4+5	6	a2 b2	تسعير الخيارات ونموذج ثنائي الحد: افتراضاته، اشتقاق معادلة سعر الشراء لفترة.	محاضرات، حل مسائل عملية نقاش جماعي	امتحان قصير، واجبات
6+7	6	a2	نموذج ثنائي الحد لفترةين اشتقاق معادلة خيار البيع لفترة.	المحاضرة حل مسائل علمية	امتحان فصلي، واجبات
8	3	c1	محفظة التحوط لمرحلة، محفظة التحوط لمرحلتين.	محاضرات، حل مسائل عملية	امتحان قصير، واجبات
9+10	6	a2	نموذج بلاك اند شولز لتسعير خيارات الشراء وخيارات البيع	المحاضرة حل مسائل رياضية	امتحان فصلي واجبات
11+12+13+14	3	b1	استراتيجيات الخيارات: استراتيجية الثنائية، استراتيجية الخنق، استراتيجية الدب والثور، استراتيجية الفراشة، استراتيجية النسر الأمريكي، استراتيجية الطوق	استخدام اسلوب حل المشكلات ومحاكاة الواقع. حل مسائل عملية محاضرات	عرض تقديمي واجبات امتحان قصير امتحان مقرر

المكونات	
مؤيد الدوري و سعيد عقل ، إدارة المشتقات المالية ٢٠١٢، اثرء للنشر والتوزيع ، ط١	الكتاب
<p>١- شقيري نوري موسى ، ادارة المشتقات المالية (الهندسة المالية) 2020 ، دار المسيرة للنشر والتوزيع ط٢ .</p> <p>٢- عبد القادر سيد فاطمة، المشتقات المالية والازمات المالية ، ٢٠١٧ ، ط١</p> <p>3- Trading & pricing financial derivatives: a guide to future, option, and swaps, Patrick Boyle & Jesse Mc dougall, 2015.</p> <p>4- Derivatives Essentials: an introduction to forwards, futures, options, and swaps, Aron Gottesman, 2016.</p>	المراجع
	موصى به للقراءة

مادة الكترونية	Power point slides
مواقع أخرى	Videos on YouTube

خطة تقييم المقرر												
المخرجات										الدرجة	طرق التقييم	
a1	a2	b1	b2	c1								
8	8	0	7	7						30	الامتحان الأول (المنتصف)	
										0	الامتحان الثاني (إذا توفر)	
3	23	11	3	10						50	الامتحان النهائي	
										20	عمال الفصل	
	5										الوظائف	
											حالات للدراسة	
		5									المناقشة والتفاعل	
											أنشطة جماعية	
											امتحانات مختبرات ووظائف	
				5							عروض تقديمية	
			5								امتحانات قصيرة	
										100	المجموع	

الانتحال
<p>الانتحال او السرقة الأدبية هو ان يأخذ شخص ما عملاً لشخص آخر ويدعي انه عمله. يوجد في الجامعة سياسة صارمة بشأن الانتحال، وإذا تم اكتشاف الانتحال بالفعل، سيتم تطبيق هذه السياسة. العقوبات تنطبق أيضاً على أي شخص يساعد شخصاً آخر (على ارتكاب الانتحال) على سبيل المثال عن طريق السماح لشخص ما بنسخ التعليمات البرمجية الخاصة بك عن علم.</p> <p>يختلف الانتحال عن العمل الجماعي حيث يشارك عدد من الأفراد الأفكار حول كيفية تنفيذ المقررات الدراسية. نشجعك بشدة على العمل في مجموعات، وبالتأكيد لن تتم معاقبتك على ذلك. هذا يعني أنه يمكنك العمل معاً في عمل مشروع او انجاز وظيفة. المهم هو أن يكون لديك فهم كامل لجميع جوانب البرنامج المكمل. من أجل السماح بالتقييم الصحيح يجب عليك الالتزام بدقة بمتطلبات عمل المشروع او الوظيفة كما هو موضح أعلاه ومفصل. هذه المتطلبات موجودة لتشجيع العمل الجماعي، والفهم الفردي، وتسهيل التقييم الفردي، ومنع الانتحال</p>