

الأستاذ: داودي حمزة



إدارة المخاطر المالية

السنة الثالثة إدارة مالية

بطاقة مادة: إدارة المخاطر المالية

الأهداف التعليمية للمادة

اكتساب طرق تقييم المخاطر اعتمادا على النماذج الإحصائية، وتحليل العلاقة بين العائد المتوقع من طرف المستثمر والمخاطر المرتبطة بتلك التوقعات، وذلك اعتمادا على قياس تكلفة الفرصة البديلة.

المعارف السابقة:

الإحصاء (1) الوصفي، الإحصاء (2) الرياضي، الإحصاء (3) التطبيقي، أسواق رؤوس الأموال.

محتوى المادة

مقدمه	
1. مفهوم المخاطر المالية 2. خصائص الخطر المالي 3. موقع المخاطر المالية على خريطة المخاطر	الفصل الأول الإطار النظري للمخاطر المالية
1. تعريف إدارة المخاطر المالية 2. أهداف إدارة المخاطر المالية 3. مراحل إدارة المخاطر المالية 4. طرق واستراتيجيات إدارة المخاطر	الفصل الثاني مفهوم إدارة المخاطر المالية
1. مفاهيم الخطر وعدم التأكد 2. المقاييس المختلفة للعائد 3. المقاييس المختلفة للخطر 4. معايير القرار في حالة عدم التأكد	الفصل الثالث اختيار الاستثمارات في حالة عدم التأكد ووجود الخطر
1. مفاهيم وأدوات الاستثمار المالي 2. أهمية الاستثمار في الأوراق المالية 3. مخاطر الاستثمار في الأوراق المالية	الفصل الرابع الاستثمار في الأوراق المالية
1. مفهوم إدارة المخاطر في الأسواق المالية 2. تحليل العلاقة بين العائد والمخاطر لورقة مالية واحدة 3. تحليل العلاقة بين العائد والمخاطرة لمحفظه أوراق مالية	الفصل الخامس إدارة المخاطر في الأسواق المالية
	الخاتمة