

توصيف مساق المشتقات المالية

1. معلومات مدرس المساق (Instructor)

اسم (مدرس / منسق) المساق :	غيث ناصر العيطان
الساعات المكتبيــــــــــــــــة :	الساعة 12 الى 1
رقم المكتب والرقم الفرعي :	
البريد الالكتروني :	ghaith.eitan@aabu.edu.jo
مساعد البحث والتدريس/المشرف/القي (إن وجد):	

2. وصف المساق (Course Description)

يتناول هذا المساق الهندسة المالية، والمشتقات المالية من حيث مفهومها وأنواعها، آليات الاستثمار فيها ودورها في إدارة المخاطر حيث تشمل المشتقات كل من الخيارات والعقود المستقبلية وكذلك المبادلات.

3. بيانات المساق (Course Title)

رقم المساق: 0503444	اسم المساق: المشتقات المالية	المستوى: بكالوريوس
طبيعة المساق: نظري + عملي	المتطلب السابق: مبادئ الاستثمار	وقت المحاضرة: 8:00-9:15
العام الجامعي: 2018 / 2019	الفصل الدراسي: الصيفي	عدد الساعات الدراسية: 48 ساعة

4. أهداف المساق (Course Objectives)

أ-	القدرة على تعريف المشتقات المالي ومعرفة أنواعها
ب-	تحليل عقود المشتقات المالية وتحديد المخاطر المتعلقة بها
ج-	القدرة على استخدام العقود المشتقات المالية المختلفة وحالاتها

5. مخرجات التعلم (Intended Student Learning Outcomes)

(المعرفة والمهارات والكفايات)

يفترض بالطالب بعد دراسته لهذا المساق أن يكون قادرا على:

After successfully completing this unit, student will be able to:

1. Construct derivatives theory from abstract theoretical concepts
2. Adapt derivatives theory to market practice
3. Evaluate the financial economic implications of financial engineering methods
4. Develop various problem solving approaches in derivative security pricing and risk management.

6. محتوى المساق (Course Content)

الموضوع	الأسبوع
Introduction Financial Derivatives	الأول
Theoretical Foundations	الثاني
Forwards and Futures	الثالث
FRAs, Swaps	الرابع
Model-Independent Option Valuation	الخامس
Review Class	السادس
الامتحان الأول	
Geometric Brownian Motion	الثامن
Black Scholes Merton	التاسع
Binomial	العاشر
Greeks	الحادي عشر
الامتحان الثاني	
Model Risk	الثالث عشر
Model Risk	الرابع عشر
Review Class	الخامس عشر
الامتحان النهائي	السادس عشر

7. استراتيجيات التعليم والتعلم وطرق التقويم

(Teaching and learning Strategies and Evaluation Methods)

ت	مخرجات التعلم	استراتيجيات التدريس	أنشطة التعلم	نوع التقييم/القياس (امتحان/عروض صفية/مناقشة/واجبات)
1	Construct derivatives theory from abstract theoretical concepts	المحاضرة أسئلة وأجوبة التدريبات والتمارين	عرض امثلة تلخيص الأفكار مقارنة النظريات والنماذج	امتحان مناقشات داخل المحاضرة
2	Adapt derivatives theory to market practice	المحاضرة أسئلة وأجوبة التدريبات والتمارين	عرض امثلة تلخيص الأفكار مقارنة النظريات والنماذج	امتحان مناقشات داخل المحاضرة واجبات
3	Develop various problem solving approaches in derivative security pricing and risk management.	المحاضرة أسئلة وأجوبة التدريبات والتمارين	عرض امثلة تلخيص الأفكار مقارنة النظريات والنماذج	امتحان مناقشات داخل المحاضرة واجبات

8. تقييم الطلبة (Assessment)

توزيع الدرجات لكل أسلوب	توقيت التقييم	الأساليب المستخدمة
10	خلال الفصل	1-أعمال الفصل: (تقرير، وظائف، حضور)
20	الأسبوع السابع	2-امتحان تحريري أول
20	الأسبوع الثاني عشر	2-امتحان تحريري ثاني
50	أسبوع الامتحانات النهائية	3-امتحان تحريري نهائي

9. الكتاب المقرر (Text Book)

Fundamentals of futures and options markets	المرجع الرئيس
John Hull	المؤلف
Pearson	الناشر
2014	السنة
7th Edition	الطبعة
	الموقع الالكتروني للمرجع

10. المراجع الإضافية (References) (وتشمل الكتب والبحوث المنشورة في الدوريات او المواقع الالكترونية)

Chance, D. (2004). An introduction to derivatives and risk management. (6th ed.). Thomson	-1
McDonald, R. (2003). Derivative markets. Addison-Wesley, Boston.	-2
Haug, E. (2007). Complete guide to option formulas. (2nd ed.). McGraw-Hill	-3