



## توصيف المقرر الدراسي

اسم المقرر:	طرق كمية في المالية
رمز المقرر:	مال 1307
البرنامج:	بكالوريوس المالية
القسم العلمي:	المالية
الكلية:	كلية الأعمال
المؤسسة:	جامعة الامام محمد بن سعود الاسلامية

## المحتويات

أ. التعريف بالمقرر الدراسي:	3.....
ب. هدف المقرر ومخرجاته التعليمية:	3.....
1. الوصف العام للمقرر:	3 .....
2. الهدف الرئيس للمقرر:	3 .....
3. مخرجات التعلم للمقرر:	3 .....
ج. موضوعات المقرر:	4.....
د. التدريس والتقييم:	5.....
1. ربط مخرجات التعلم للمقرر مع كل من استراتيجيات التدريس وطرق التقييم	5 .....
2. أنشطة تقييم الطلبة	6 .....
د. سلامة المنهج والمحتوى المرئي والمسموع ومقدم اللقاء المسجل:	6.....
هـ - أنشطة الإرشاد الأكاديمي والدعم الطلابي:	6.....
و - مصادر التعلم والمرافق:	6.....
1. قائمة مصادر التعلم:	6 .....
2. المرافق والتجهيزات المطلوبة:	7 .....
ز. تقويم جودة المقرر:	7.....
ح. اعتماد التوصيف	Error! Bookmark not defined.....



## أ. التعريف بالمقرر الدراسي:

1. الساعات لمعمدة: أربعة ساعات	
2. نوع المقرر	
أ. <input type="checkbox"/> متطلبات جامعة <input type="checkbox"/> متطلبات كلية <input checked="" type="checkbox"/> متطلبات قسم <input type="checkbox"/> أخرى	ب. <input type="checkbox"/> إجباري <input checked="" type="checkbox"/> اختياري
3. السنة / المستوى الذي يقدم فيه المقرر: المستوى التاسع	
4. المتطلبات السابقة لهذا المقرر (إن وجدت) تطبيقات الحاسب في المالية 1303	
5. المتطلبات المتزامنة مع هذا المقرر (إن وجدت)	

## 6. نمط الدراسة (اختر كل ما ينطبق)

م	نمط الدراسة	عدد الساعات التدريسية	النسبة
1	المحاضرات التقليدية	48	100%
2	التعليم المدمج		
3	التعليم الإلكتروني		
4	التعليم عن بعد		
5	أخرى		

## 7. ساعات الاتصال (على مستوى الفصل الدراسي)

م	النشاط	ساعات التعلم
1	محاضرات	48
2	معمل أو استوديو	
3	دروس إضافية	
4	أخرى (تذكر)	
	الإجمالي	48

## ب. هدف المقرر ومخرجاته التعليمية:

1. الوصف العام للمقرر: يستعرض مقرر مال 1307 الأساليب والطرق الكمية المستخدمة عند اتخاذ القرارات المالية ومجال البحث العلمي. ويقدم نبذة عن أنواع البيانات المالية وخصائصها، ويستعرض الأدوات الإحصائية لاختبار الفروض التي تقوم عليها نماذج الاقتصاد القياسي، ويشرح المفاهيم النظرية الأساسية للنماذج المستخدمة في الاقتصاد القياسي المالي ويبين كيفية اختيار المنهجية الملائمة مع نوعية البيانات المتاحة، ويمكن الطالب من استخدام أحد برمجيات الاقتصاد القياسي على بيانات حقيقية.
2. الهدف الرئيس للمقرر بعد انتهاء الطالب من دراسة هذا المقرر يكون الطالب قادراً على: <ul style="list-style-type: none"> <li>- التمييز بين أنواع البيانات المستخدمة في مجال المالية وطرق عرضها وتحليلها</li> <li>- تطبيق طرق الاقتصاد القياسي على مجموعة متنوعة من المسائل المتعلقة بتخصص المالية</li> <li>- نمذجة وتحليل السلاسل الزمنية المالية</li> <li>- استخدام برمجيات الاقتصاد القياسي لتطبيق النماذج والطرق الكمية على مختلف أنواع البيانات</li> </ul>

## 3. مخرجات التعلم للمقرر:

رمز مخرج التعلم المرتبط للبرنامج	مخرجات التعلم للمقرر
1	المعرفة والفهم

رمز مخرج التعلم المرتبط للبرنامج	مخرجات التعلم للمقرر
1.1	يعرف الطالب أنواع البيانات المالية وطرق عرضها وتحليلها
1.2	يعدد المفاهيم النظرية الأساسية للنماذج المستخدمة في الاقتصاد القياسي المالي
1.3	يميز الطالب بين طرق تحليل السلاسل الزمنية المالية
2	<b>المهارات</b>
2.1	يطبق الطالب طرق الاقتصاد القياسي في مجال المالية
2.2	يحلل الطالب ويعرض السلاسل الزمنية باستخدام برمجيات الاقتصاد القياسي المتاحة لطلاب البرنامج.
2.3	يقيم الطالب نماذج تذبذبات السلاسل الزمنية المالية
3	<b>القيم</b>
3.1	يتحمل المسؤولية في التعلم الذاتي والتعرف على مصادر المعلومات وطرق الاستفادة منها بشفاافية ونزاهة
3.2	يعبر باستقلالية عن رأيه في المسائل المحتملة لأكثر من رأي، بطريقة تراعي مشاعر الآخرين، ولا تتعارض مع قيم المجتمع وأخلاقياته.
3.3	يبادر في استكشاف أبعاد موضوع البحث وحلها بتميز بالتعاون مع فريق البحث أو قيادته.

### ج. موضوعات المقرر

م	قائمة الموضوعات	ساعات الاتصال
1	<b>أنواع البيانات وخصائصها</b> (تعريف الطرق الكمية وأهميتها في مجال المالية، البيانات الاسمية، البيانات الترتيبية، بيانات السلاسل الزمنية، البيانات المقطعية، البيانات الطولية (الجدولية Panel)، خصائص البيانات، ادخال أنواع البيانات برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة وطرق عرضها)	3
2	<b>محاضرة تعريفية عن البرنامج الاقتصادي المعتمد:</b> النافذة الرئيسية، أوراق العمل، إدخال البيانات، الرسومات والإحصاءات الوصفية، استخدام معادلات الانحدار، قائمة بأهم طرق التقدير التي سيتم استخدامها في المقرر.	3
3	<b>مراجعة سريعة للأسس النظرية لنماذج الانحدار الخطي</b> (مفهوم الارتباط وطرق قياسه، تعريف الانحدار، الانحدار الخطي البسيط، فرضيات الانحدار الخطي البسيط، طرق تقدير معامل نماذج الانحدار الخطي، طريقة المربعات الصغرى، الدلالة الإحصائية للتقديرات، الانحدار الخطي المتعدد، اختبار الفرضيات المتعددة...)، اختبار اختلاف التباين، واختبار الارتباط الذاتي وتقديم الحلول المناسبة باستخدام طريقة المربعات الصغرى المعممة، المتغيرات الوهمية وأسس استخدامها مع تطبيق على المالية لقياس أثر شهر رمضان أو أثر نهاية السنة ونحوها.	6
4	<b>تطبيقات نماذج الانحدار الخطي في المالية</b> (يتم في كل هذه التطبيقات استخدام برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة لتحليل النتائج)، وتشمل التطبيقات الطرق والحالات الآتية: 1. تطبيق نموذج الانحدار الخطي البسيط في المالية (طريقة دراسة الحدث: خطوات إجراء دراسة الحدث، أمثلة لاستخدام الطريقة، حساب العوائد غير الطبيعية وتفسير النتائج) 2. تطبيق نموذج الانحدار الخطي المتعدد في المالية (تطبيق نموذج التسعير بالمراجعة...) 3. تطبيق نموذج الانحدار الخطي باستخدام برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة باستعمال بيانات مقطعية في المالية (دراسة محددات الاداء المالي للبنوك أو ربحية الشركات في السوق المالي السعودي في سنة معينة) 4. تطبيق نموذج الانحدار ذو المتغير التابع المتقطع في المالية (الانحدار اللوجستي، أمثلة لاستخدام الانحدار، طريقة تفسير النتائج) 5. مقدمة عن تطبيق نموذج الانحدار الخطي باستعمال سلاسل زمنية وبيانات مقطعية في المالية (انحدار البيانات الطولية): مبررات استخدام هذه الطريقة، أمثلة لاستخدام هذه الطريقة، طريقة إدخال البيانات وتفسير النتائج، الفرق بين نموذج الأثر الثابت والأثر العشوائي)	15
5	<b>مقدمة عن السلاسل الزمنية في المالية</b> (أنواع وخصائص السلاسل الزمنية، أمثلة لسلاسل زمنية في المالية (العائد وطرق حسابه)، ادخال السلاسل الزمنية المالية باستخدام برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة وعرض الاحصائيات الوصفية والصور وتحليلها...)	3

6	15	نمذجة وتحليل السلاسل الزمنية المالية الأحادية (استقرارية السلاسل الزمنية واختبارات جذر الوحدة، نماذج المتوسط المتحرك، نماذج الارتباط الذاتي، نموذج الانحدار الذاتي والمتوسط المتحرك (ARMA)، أسلوب بوكس جينكينز، التنبؤ في المالية باستخدام نماذج (ARMA)، فرضية المسار العشوائي، استخدام الفرضية لاختبار كفاءة السوق المالية، تطبيق نماذج تحليل السلاسل الزمنية باستخدام برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة باستخدام سلاسل زمنية من الاسواق المالية، وتحليل المخرجات...)
7	3	عرض مشروع متكامل لتطبيقات الطرق الكمية على أحد المسائل في مجال المالية
	48	المجموع

#### د. التدريس والتقييم:

##### 1. ربط مخرجات التعلم للمقرر مع كل من استراتيجيات التدريس وطرق التقييم

الرمز	مخرجات التعلم	استراتيجيات التدريس	طرق التقييم
1.0	المعرفة والفهم		
1.1	يتعرف الطالب على أنواع البيانات المالية وطرق عرضها وتحليلها	- إلقاء المحاضرات على الطلاب والتي من خلالها يتم شرح وتفسير كامل مفردات المقرر.	- اختبارات الأعمال الفصلية: اختبارين يمثلان 40% من الدرجة النهائية).
1.2	يتعرف الطالب على كيفية تطبيق طرق الاقتصاد القياسي في القرارات المالية	- تقديم المحاضرات الإضافية المخصصة لحل التمارين والمسائل المتعلقة بالمقرر؛	
1.3	يتعرف الطالب على طرق تحليل السلاسل الزمنية المالية	- التمارين الفردية والجماعية، التي تركز على إكساب الطالب المعارف الأساسية للنماذج والطرق الكمية المطبقة في مجال المالية	- الاختبار النهائي (40% من الدرجة النهائية).
2.0	المهارات		
2.1	يكتسب الطالب مهارة تطبيق طرق الاقتصاد القياسي في مجال المالية	- استخدام الحالات الدراسية في التدريس	- اختبارات الأعمال الفصلية والاختبار النهائي ويتضمن كل اختبار على الأقل مسألة تطبيقية تتطلب تطبيق المعارف التي تم اكتسابها
2.2	يكتسب الطالب مهارة تحليل وعرض السلاسل الزمنية باستخدام برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة	- تعويد الطالب على المبادرة بطرح الحلول للمسائل المالية التي يتم مناقشتها في المحاضرة .	- مشروع جماعي يتطلب استخدام برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة والتواصل مع فريق العمل لتقييم أداء الطلاب ومدى استيعابهم للمحاور الرئيسية للمقرر
2.3	يكتسب الطالب مهارة نمذجة خصائص السلاسل الزمنية المالية	- إعطاء الطلاب تمارين فردية وجماعية لصقل مهاراتهم في تطبيق الأساليب والطرق الكمية في مجال المالية.	- واجب فردي يتطلب تطبيق المعارف المكتسبة باستخدام برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة والقيام بالتحليل والمناقشة للنتائج
3.0	القيم		
3.1	يتحمل المسؤولية في التعلم الذاتي والتعرف على مصادر المعلومات وطرق الاستفادة منها بشفافية ونزاهة	- يتضمن المقرر على مشروع جماعي يخصص له فريق، ويعين له رئيس، تتمثل مهمته في قيادة الفريق في عملية مناقشة المسألة وتقديم مقترحات لحلها.	- تقييم أداء الطالب من خلال المشروع الجماعي.
3.2	يعبر باستقلالية عن رأيه في المسائل المحتملة لأكثر من رأي، بطريقة تراعي مشاعر الآخرين، ولا تتعارض مع قيم المجتمع وأخلاقياته.	- استخدام طريقة التعلم عبر التطبيق من خلال ربك كل الجوانب النظرية بتطبيقات انطلاقا من بيانات فعلية في المجال المالي	- تقييم أداء الطالب من خلال الواجب الفردي
3.3	يبادر في استكشاف أبعاد موضوع البحث وحلها بتميز		

الرمز	مخرجات التعلم	استراتيجيات التدريس	طرق التقييم
	بالتعاون مع فريق البحث أو قيادته.		

## 2. أنشطة تقييم الطلبة

م	أنشطة التقييم	توقيت التقييم (بالأسبوع)	النسبة من إجمالي درجة التقييم
1	اختبار فصلي	7	30%
2	واجب فردي (تطبيق باستخدام برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة على استخدام الانحدار الخطي)	4-3	15%
3	مشروع جماعي (تطبيق باستخدام برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة على نمذجة السلاسل الزمنية)	11-9	15%
4	الاختبار النهائي	13	40%

أنشطة التقييم (اختبار تحريري، شفهي، عرض تقديمي، مشروع جماعي، ورقة عمل الخ)

## د. سلامة المنهج والمحتوى المرئي والمسموع ومقدم اللقاء المسجل:

م	مجال التقويم	سليم	غير سليم (توضيح عدم السلامة)
1	(فكرياً) السلامة الفكرية لمحتوى المقرر	√	
2	(منهجياً) مطابقته مع مفردات المقرر	√	
3	(علمياً) مناسبته لمستوى الطلاب وقدراتهم	√	
4	السلامة (الفكرية، المنهجية، العلمية) لمقدم اللقاء المسجل المرئي والمسموع الموجود في محتويات المقرر.	√	
توضيح عدم السلامة			
لا يوجد			

## هـ - أنشطة الإرشاد الأكاديمي والدعم الطلابي:

-	الساعات المكتبية المخصصة لأستاذ المقرر من قبل القسم (3 ساعات أسبوعياً)
-	تواصل أستاذ المادة مع الطلاب عبر منصة المقرر على شبكة الانترنت أو البريد الإلكتروني
-	الساعات المخصصة للمرشدين الأكاديميين بالقسم (ساعة أسبوعياً)

## و - مصادر التعلم والمرافق:

### 1. قائمة مصادر التعلم:

Chris Brooks (2019), "Introductory Econometrics for Finance", Cambridge University Press; 4th edition	المرجع الرئيس للمقرر
- Walter Enders (2014), "Applied Econometric Time Series", Wiley, 4 <sup>th</sup> Edition - Frank J. Fabozzi, Sergio M. Focardi, Svetlozar T. Rachev, Bala G. Arshanapalli, Markus Hoechstetter (2014), "The Basics of Financial	المراجع المساندة

Econometrics: Tools, Concepts, and Asset Management Applications”, Wiley, 4 <sup>th</sup> Edition Brooks and Robert Wichmann (2019) EViews Guide for Introductory Econometrics for Finance Chris, The ICMA Centre, Henley Business School, University of Reading. <a href="https://ssrn.com/abstract=3466908">https://ssrn.com/abstract=3466908</a> Economic and Financial Modelling with EViews A Guide for Students and Professionals, Aljandali, Abdulkader & Tatahi, Motasam, Springer 2018 .	
	المصادر الإلكترونية
	أخرى

## 2. المرافق والتجهيزات المطلوبة:

متطلبات المقرر	العناصر
قاعة دراسية	المرافق (القاعات الدراسية، المختبرات، قاعات العرض، قاعات المحاكاة ... إلخ)
جهاز حاسب الي وبروجكتر توفر الانترنت برنامج الاقتصاد القياسي المعتمد: أحدث نسخة من برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة (EViews) أداة التحليل الاحصائي في برنامج (MS Excel) لغة (R)	التجهيزات التقنية (جهاز عرض البيانات، السبورة الذكية، البرمجيات)
معمل حاسب آلي	تجهيزات أخرى (تبعاً لطبيعة التخصص)

## ز. تقييم جودة المقرر:

طرق التقييم	المقيمون	مجالات التقييم
<ul style="list-style-type: none"> <li>نتائج مسح تقييم الطلاب للمقرر.</li> <li>مرئيات الطلاب التي يتم الحصول عليها من الطلاب مشافهة.</li> <li>تعليق الطلاب على المقرر من خلال منصة التعليم المعتمدة من الجامعة ومنصات التواصل الاجتماعي.</li> </ul>	الطلاب	تقييم فعالية التدريس
<ul style="list-style-type: none"> <li>في نهاية كل فصل دراسي يقوم منسق المقرر بإعداد تقرير، يحوي ملخصاً عن مرئيات الطلاب وتقييم لسيير الدراسة وتحديد التغييرات التي يجب القيام بها إذا لزم الأمر.</li> <li>تواصل أستاذ المقرر مباشرة عبر البريد الإلكتروني مع الطلاب الذين درسوا المقرر لتقديم مقترحاتهم لتطوير المقرر.</li> <li>مراجعة تقرير المقرر الذي يعده منسق المقرر من قبل رئيس القسم أو مجلس القسم.</li> </ul>	الطلاب، رئيس القسم، أعضاء مجلس القسم	تقييم عملية التدريس

مجالات التقويم	المقيمون	طرق التقويم
مدى تحقق مخرجات التعلم للبرنامج	مدرسين مستقلين، رئيس القسم	<ul style="list-style-type: none"> <li>إشراك عضو هيئة تدريس آخر لنفس المقرر (أو مقرر مماثل) من مؤسسة تعليمية أخرى لتقويم توصيف المقرر والتمارين التطبيقية والاختبارات.</li> <li>مراجعة نسب النجاح والرسوب وتوزيع معدلات الطلاب في المقرر من قبل رئيس القسم، ومناقشة تقرير قياس نواتج التعلم وتحقيق المستهدفات.</li> <li>تكوين ملف مشترك عبر الإنترنت (عبر خدمة شارك من تقنية المعلومات بالجامعة) تجمع فيه كل الإنجازات المتعلقة بالمقرر (العروض المرئية والتمارين والمراجع والاختبارات وتوصيف المقرر وغيرها) بما يسمح لأعضاء مجلس القسم بالاطلاع عليها وإبداء الرأي والاقتراحات.</li> </ul>
المراجعة الدورية لمدى فعالية المقرر الدراسي والتخطيط لتطويره	منسق المقرر، مجلس القسم	<ul style="list-style-type: none"> <li>إعداد تقرير المقرر بصفة جماعية لتحديد نقاط القوة والضعف من خلال النتائج النهائية، ومناقشته في مجلس القسم.</li> <li>الرجوع إلى مختلف أعضاء هيئة التدريس في القسم لمعرفة مدى توافق محتوى المقرر مع محتوى بقية المقررات.</li> <li>مناقشة التعديلات الضرورية على توصيف المقرر في مجلس القسم بشكل دوري</li> </ul>

مجالات التقويم (مثل: فاعلية التدريس، فاعلة طرق تقييم الطلاب، مدى تحصيل مخرجات التعلم للمقرر، مصادر التعلم ... إلخ)  
المقيمون (الطلبة، أعضاء هيئة التدريس، قيادات البرنامج، المراجع النظير، أخرى (يتم تحديدها))  
طرق التقويم (مباشر وغير مباشر)

#### ط. اعتماد التوصيف

جهة الاعتماد	قسم المالية
رقم الجلسة	4
تاريخ الجلسة	1445/04/15