



اعتماد  
NCAA  
T4  
2020

## 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 ومخراجهاته 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 ومقاييس 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 المعتمدة: أربعة ساعات				
2. نوع المقرر				
<input type="checkbox"/> أخرى	<input checked="" type="checkbox"/> متطلب قسم	<input type="checkbox"/> متطلب كلية	<input type="checkbox"/> اختياري	<input checked="" type="checkbox"/> إجباري
3. المستوي 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)

نوع الدراسة	م
المحاضرات التقليدية	1
التعليم المدمج	2
التعليم الإلكتروني	3
التعليم عن بعد	4
أخرى	5

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

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

## بـ- 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 برامجيات الاقتصاد القياسي على بيانات حقيقة.

### 2. الهدف الرئيس للمقرر:

بعد انتهاء الطالب من دراسة هذا المقرر يكون الطالب قادرًا على:

- التمييز بين أنواع البيانات المستخدمة في مجال المالية وطرق عرضها وتحليلها
- تطبيق طرق الاقتصاد القياسي على مجموعة متنوعة من المسائل المتعلقة بتخصص المالية
- نماذجة وتحليل السلسل الرمزية المالية
- استخدام برامجيات الاقتصاد القياسي لتطبيق النماذج والطرق الكمية على مختلف أنواع البيانات

### 3. مخرجات التعلم للمقرر:

رمز مخرج التعلم المرتبط للبرنامج	مخرجات التعلم للمقرر	المعرفة والفهم
		1



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 السلسل الزمنية المالية
	<b>المهارات</b>
2.1	يطبق الطالب طرق الاقتصاد القياسي في مجال المالية
2.2	يحل الطالب وبعرض السلسل الزمنية باستخدام برمجيات الاقتصاد القياسي المتاحة لطلاب البرنامج.
2.3	يقيم الطالب نماذج تنبؤات السلسل الزمنية المالية
	<b>القيم</b>
3.1	يتتحمل المسؤولية في التعلم الذاتي والتعرف على مصادر المعلومات وطرق الاستفادة منها بشفافية 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

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



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

#### د. التدريس والتقييم:

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

الرمز	مخرجات التعليم	استراتيجيات التدريس	طرق التقييم
1.0	المعرفة والفهم		
1.1	يتعرف الطالب على انواع 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	- تقييم المحاضرات الإضافية المخصصة لحل التمارين والمسائل المتعلقة بالمقرر؛	- الاختبار النهائي (40% من الدرجة النهائية).
1.3	يتعرف الطالب على طرق تحليل السلسل الزمنية المالية	- التمارين الفردية والجماعية، التي تركز على إكساب الطالب المعارف الأساسية للنماذج والطرق الكمية المطبقة في مجال المالية	
2.0	المهارات		
2.1	يكسب الطالب مهارة تطبيق طرق الاقتصاد القياسي في مجال المالية	- استخدام الحالات الدراسية في التدريس	- اختبارات الأعمال الفصلية والاخبار النهائي ويتضمن من كل اختبار على الأقل مسألة تطبيقية تتطلب تطبيق المعرفات التي تم اكتسابها
2.2	يكسب الطالب مهارة تحليل وعرض السلسل الزمنية باستخدام برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة	- تعويد الطالب على المبادرة بطرححلول للمسائل المالية التي يتم مناقشتها في المحاضرة.	- مشروع جماعي يتطلب استخدام برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة والتواصل مع فريق العمل لتقييم أداء الطلاب ومدى استيعابهم لمحاور الرئيسية للمقرر
2.3	يكسب الطالب مهارة نمدجة خصائص السلسل الزمنية المالية	- تحفيز الطلاب على التفكير المنطقي حل المسائل من خلال خطوات محددة ومتسلسلة.	- واجب فردي يتطلب تطبيق المعرفات المكتسبة باستخدام برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة والقيام بالتحليل والمناقشة للنتائج
3.0	القيم		
3.1	يتتحمل 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 مقتراحات 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 انتلاقاً من بيانات فعلية في المجال المالي	- تقييم أداء الطالب من خلال الواجب الفردي
3.3	بيادر 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 الخطى)	4-3	%15
3	مشروع جماعي (تطبيق باستخدام برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة على نبذة السلسل 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) مناسبيه لمستوى الطلاب وقدراتهم	✓	
4	السلامة (الفكرية، المنهجية، العلمية) لمقدم اللقاء المسجل المرئي والمسموع الموجود في محتويات المقرر.	✓	
			<b>توضيح عدم السلامة</b>
			لا يوجد

## هـ - أنشطة الإرشاد الأكاديمي والدعم الطلابي:

- الساعات المكتبية المخصصة لأستاذ المقرر من قبل القسم (3 ساعات أسبوعياً)
- تواصل أستاذ المادة مع الطالب 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	المراجع الرئيسية 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 Hoechstoetter (2014), “The Basics of Financial	المراجع المساعدة



Econometrics: Tools, Concepts, and Asset Management Applications”, Wiley, 4 <sup>th</sup> Edition Brooks and Robert Wichmann (2019) EVViews 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 EVViews A Guide for Students and Professionals, Aljandali, Abdulkader & Tatahi, Motasam, Springer 2018 .	
	المصادر الإلكترونية
	أخرى

## 2. المراافق والتجهيزات المطلوبة:

متطلبات المقرر	العناصر
قاعة دراسية	<b>المراافق</b> (قاعات الدراسية، المختبرات، قاعات العرض، قاعات المحاكاة ... الخ)
جهاز حاسب آلي وبروجكتر توفر الانترنت برنامج الاقتصاد القياسي المعتمد: أحدث نسخة من برمجية الاقتصاد القياسي المعتمدة (EVViews) أداة التحليل الاحصائي في برنامج (MS Excel) لغة (R)	<b>التجهيزات التقنية</b> (جهاز عرض البيانات، السيرة الذكية، البرمجيات)
معلم حاسب آلي	تجهيزات أخرى (تبعاً لطبيعة الشخص)

## ز. تقويم جودة المقرر:

طرق التقييم	المقيمون	مجالات التقويم
<ul style="list-style-type: none"> <li>نتائج مسح تقويم الطلاب للمقرر.</li> <li>مرئيات الطلاب التي يتم الحصول عليها من الطلاب مشافهة.</li> </ul> <p>تعليق الطلاب على المقرر من خلال منصة التعليم المعتمدة من الجامعة و المنصات التواصل الاجتماعي.</p>	الطلاب	تقويم 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 لسير الدراسة وتحديد التغييرات التي يجب القيام بها إذا لزم الأمر.</li> <li>تواصل أستاذ المقرر مباشرةً عبر البريد الإلكتروني مع الطالب الذين درسوا المقرر لتقديم مقترناتهم 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	تقويم عملية التدريس



طرق التقييم	المقيمون	مجالات التقويم
<ul style="list-style-type: none"> <li>إشراك عضو هيئة تدريس آخر لنفس المقرر (أو مقرر مماثل) من مؤسسة تعليمية أخرى لتقدير 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 الإنترن特 (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>	مدربين مستقلين، رئيس القسم	مدى تحقق مخرجات التعلم للبرنامج
<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> </ul> <p><b>مناقشة التعديلات الضرورية على توصيف المقرر في مجلس القسم بشكل دوري</b></p>	منسق المقرر، مجلس القسم	المراجعة الدورية لمدى فعالية المقرر الدراسي والتخطيط لتطويره

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

#### ط. اعتماد التوصيف

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

