

رقم الدورة 1475

دورة استراتيجيات إدارة الأصول المتقدمة

إدارة الاستثمار والأصول
التمويل والاستثمار والخدمات المصرفية

طريقة التقديم

حضور

المدة

5 أيام



نظرة عامة على الدورة

تقدم دورة استراتيجيات إدارة الأصول المتقدمة إطاراً مهنياً متقدماً وعملياً لتطوير وإدارة الاستراتيجيات الحديثة لإدارة الأصول والمخاطر الاستثمارية، مع التركيز على تعظيم القيمة وتحقيق التوازن بين العائد والمخاطر والسيولة والأهداف طويلة الأجل. وتهدف الدورة إلى تطوير قدرة المشاركين على تقييم الأصول وتحديد الفرص الاستثمارية وبناء محافظ متوازنة وإدارة المخاطر ومتابعة الأداء في ظل تغيرات الأسواق والظروف الاقتصادية.

تتطلب الإدارة الفعالة للأصول أكثر من اختيار أدوات استثمارية ذات عوائد مرتفعة، إذ تعتمد على فهم طبيعة الأصول ودوراتها الاقتصادية ومستويات السيولة والمخاطر والعلاقة بينها وبين بقية مكونات المحفظة. وتوضح الدورة كيفية بناء استراتيجيات متكاملة تراعي أهداف المستثمر وقيود الاستثمار والأفق الزمني والقدرة على تحمل المخاطر، مع تحقيق التوازن بين النمو والحماية والحفاظ على القيمة.

يتناول البرنامج مجموعة متقدمة من موضوعات إدارة الأصول، بما يشمل تخصيص الأصول الاستراتيجي والتكتيكي، وتنويع المحافظ، وتحليل الارتباطات، وإدارة مخاطر السوق والائتمان والسيولة والتركيز، وإدارة الدخل الثابت والأسهم والأصول البديلة والأصول الحقيقية. كما يركز على تقييم أداء الأصول والمخاطر وقياس العائد المعدل حسب المخاطر، وتحليل مساهمة القرارات الاستثمارية، وإعادة التوازن وإدارة السيولة.

ويركز البرنامج كذلك على تطوير استراتيجيات إدارة الأصول في البيئات المتغيرة، بما يشمل التغيرات في أسعار الفائدة والتضخم ودورات الأعمال وتقلبات الأسواق وتغيرات السيولة والظروف الجيوسياسية والاقتصادية. كما يتناول استخدام السيناريوهات واختبارات الضغط وتحليل الحساسية لتقييم قدرة المحافظ على تحمل الظروف المعاكسة، إلى جانب أهمية الحوكمة وسياسات الاستثمار وإدارة المخاطر والرقابة المؤسسية.

ومن خلال دراسات الحالة والتمارين التحليلية وورش بناء المحافظ وإعادة التوازن وتحليل الأداء واختبارات الضغط وتطوير السياسات الاستثمارية، تساعد دورة استراتيجيات إدارة الأصول المتقدمة المشاركين على تطوير قدرات عملية قابلة للتطبيق في البنوك وشركات إدارة الأصول وصناديق الاستثمار والمستثمرين المؤسسيين والجهات الحكومية والمؤسسات السيادية والشركات الكبرى. كما تناسب المديرين التنفيذيين ومديري الاستثمار ومديري المحافظ والمتخصصين في المخاطر والخزينة وصناع القرار المسؤولين عن رأس المال والاستثمار.

أهداف الدورة

- تحليل المبادئ المتقدمة لإدارة الأصول ودورها في تحقيق الأهداف الاستثمارية طويلة الأجل خلال فترة الدورة.
- تقييم خصائص فئات الأصول المختلفة من حيث العائد والمخاطر والسيولة والعلاقة مع ظروف الأسواق.
- تطوير استراتيجيات متقدمة لتخصيص الأصول تتوافق مع أهداف المستثمر وتحمل المخاطر والأفق الزمني.
- تطبيق أساليب التنويع وتحليل الارتباطات وإدارة التركز لتحسين هيكل المحافظ الاستثمارية.
- تقييم مخاطر السوق والائتمان والسيولة والعملات والتركيز والمخاطر المرتبطة بالأصول المختلفة.
- تصميم استراتيجيات متكاملة لإدارة المحافظ تشمل التخصيص الاستراتيجي والتكتيكي وإعادة التوازن.
- تطبيق تحليل السيناريوهات واختبارات الضغط لتقييم مرونة المحافظ أمام التغيرات السوقية والاقتصادية.
- تقييم أداء الأصول والمحافظ باستخدام مؤشرات العائد والمخاطر والعائد المعدل حسب المخاطر.
- تحليل مساهمة قرارات اختيار الأصول وتخصيصها في الأداء الإجمالي للمحفظة.
- تطوير أطر عملية لإدارة السيولة والاحتياجات النقدية وإعادة توازن المحافظ.
- تحسين الحوكمة والسياسات الاستثمارية وآليات الرقابة على إدارة الأصول والمخاطر.
- موازنة استراتيجيات إدارة الأصول مع أهداف خلق القيمة والاستدامة المالية والمرونة الاستثمارية.

الفئة المستهدفة

تستهدف هذه الدورة المهنيين العاملين في إدارة الأصول وإدارة المحافظ والاستثمار وإدارة الثروات والخزينة وإدارة المخاطر والتمويل المؤسسي. وتشمل الفئات المستهدفة مديري الأصول، ومديري المحافظ، ومديري الاستثمار، ومحلي الاستثمار، ومتخصصي تخصيص الأصول، ومتخصصي إدارة المخاطر، ومديري الخزينة، والمحليين الماليين، ومتخصصي الاستثمار المؤسسي، والمهنيين المسؤولين عن تطوير أو تنفيذ أو مراقبة الاستراتيجيات الاستثمارية.

كما تناسب الرؤساء التنفيذيين والمديرين الماليين ورؤساء الاستثمار ومديري إدارة الأصول ومديري المحافظ وأعضاء لجان الاستثمار وصناع القرار المسؤولين عن تخصيص رأس المال وإدارة السيولة والاستثمارات الاستراتيجية. ويمكن أن يستفيد منها العاملون في الجهات الحكومية والوزارات والمؤسسات السيادية والبنوك والمؤسسات المالية وصناديق الاستثمار وشركات التأمين وقطاعات النفط والغاز والطاقة والبنية التحتية والشركات الكبرى التي تدير أصولاً أو محافظ استثمارية.

وتوفر الدورة قيمة خاصة للمهنيين المشاركين في إعداد سياسات الاستثمار وتقييم الأصول وبناء المحافظ وإدارة المخاطر وقياس الأداء وإعادة التوازن والتخطيط النقدي. كما تناسب المتخصصين في الحوكمة والامتثال والتدقيق الداخلي الذين يحتاجون إلى فهم العلاقة بين إدارة الأصول والسياسات الاستثمارية وإدارة المخاطر والأداء المؤسسي.

مخرجات التعلم

- شرح المفاهيم المتقدمة في إدارة الأصول والاستراتيجية الاستثمارية وإدارة المحافظ.
- تحليل خصائص الأصول المختلفة وتقييمها من حيث العائد والمخاطر والسيولة والدورة الاقتصادية.
- تطوير استراتيجيات مناسبة لتخصيص الأصول وفق أهداف الاستثمار وتحمل المخاطر والقيود المؤسسية.
- بناء محافظ متنوعة باستخدام مبادئ التنوع والارتباط وإدارة التركز.
- تقييم المخاطر الرئيسية المؤثرة في الأصول والمحافظ ووضع آليات مناسبة للحد منها.
- تطبيق أساليب التخصيص الاستراتيجي والتكتيكي للأصول وإعادة التوازن.
- إجراء تحليل السيناريوهات واختبارات الضغط لقياس قدرة المحفظة على تحمل ظروف السوق المعاكسة.
- تقييم أداء المحافظ باستخدام العائد المطلق والنسبي ومؤشرات الأداء المعدلة حسب المخاطر.
- تحليل أثر اختيار الأصول وتخصيصها على النتائج الاستثمارية الإجمالية.
- تطوير استراتيجيات لإدارة السيولة والاحتياجات النقدية في المحافظ الاستثمارية.

- إعداد تقارير استثمارية وتنفيذية توضح الأداء والمخاطر والفرص والتوصيات.
- إعداد إطار متكامل لإدارة الأصول يربط الاستثمار بالحوكمة والمخاطر والاستدامة وخلق القيمة.
- المحاوّر التدريبية:

محاوّر الدورة

اليوم الأول

أسس إدارة الأصول والاستراتيجية الاستثمارية المتقدمة

- مفهوم إدارة الأصول ودورها في خلق القيمة طويلة الأجل
- العلاقة بين استراتيجية الاستثمار وهيكل الأصول والالتزامات
- أهداف المستثمر وقيود الاستثمار والأفق الزمني
- خصائص فئات الأصول الرئيسية
- العلاقة بين العائد والمخاطر والسيولة
- دور الظروف الاقتصادية ودورات الأعمال في إدارة الأصول
- تحديد المخاطر والأهداف الاستثمارية
- صياغة سياسات وأهداف إدارة الأصول
- التطبيق العملي: تحليل حالة استثمارية وتحديد الأهداف والقيود وفئات الأصول المناسبة

اليوم الثاني

تخصيص الأصول وبناء المحافظ وتنويع الاستثمارات

- مبادئ التخصيص الاستراتيجي للأصول
- التخصيص التكتيكي للأصول ودوره في الاستفادة من ظروف الأسواق

اليوم الثاني — تابع

- التنوع وتحليل الارتباط بين الأصول
- إدارة التركز والتعرضات
- بناء المحافظ وفق مستويات مختلفة من المخاطر
- اختيار الأصول وربطها بالأهداف الاستثمارية
- إدارة السيولة والالتزامات المستقبلية
- المفاضلة بين العائد والمخاطر وكفاءة المحفظة
- التطبيق العملي: بناء محفظة استثمارية متكاملة وفق أهداف ومخاطر وقيود محددة

اليوم الثالث

إدارة المخاطر واختبارات الضغط ومرونة المحافظ

- إدارة مخاطر السوق والائتمان والسيولة والعمليات
- مخاطر التركز ومخاطر الأطراف المقابلة
- تحليل القلب والانخفاضات والمخاطر السلبية
- تحديد حدود المخاطر ومؤشرات المراقبة
- تحليل السيناريوهات والظروف الاقتصادية البديلة
- اختبارات الضغط للمحافظ والأصول
- تحليل الحساسية للمتغيرات الرئيسية
- تقييم مرونة المحافظ واستراتيجيات الاستجابة
- التطبيق العملي: إجراء اختبار ضغط لمحفظة استثمارية وتحليل التأثيرات المحتملة على المخاطر والسيولة والعائد

اليوم الرابع

إدارة الأصول البديلة والأصول الحقيقية وتحسين المحفظة

- دور الأصول البديلة ضمن استراتيجيات إدارة الأصول
- الاستثمارات الخاصة ورأس المال الجريء من منظور المحفظة
- العقارات والبنية التحتية والأصول الحقيقية
- الاستثمار في الأصول المرتبطة بالموارد والطاقة والسلع
- إدارة السيولة في الأصول الأقل سيولة
- تقييم مخاطر الأصول البديلة
- تحسين التنوع بين الأصول التقليدية والبديلة
- إعادة تقييم هيكل المحافظ وفق ظروف السوق
- التطبيق العملي: تصميم مزيج استثماري يجمع بين الأصول التقليدية والبديلة وتحليل أثره على العائد والمخاطر والسيولة

اليوم الخامس

قياس الأداء والحوكمة والاستراتيجية التنفيذية لإدارة الأصول

- قياس أداء الأصول والمحافظ
- تحليل الأداء المطلق والنسبي
- المؤشرات المرجعية واختيارها
- قياس الأداء المعدل حسب المخاطر
- تحليل مساهمة تخصيص الأصول واختيار الاستثمارات
- إعادة توازن المحافظ وآليات تحديد محفزات التعديل
- التقارير الاستثمارية ولوحات المتابعة للإدارة العليا

اليوم الخامس — تابع

- الحوكمة وسياسات الاستثمار والرقابة على المخاطر
- التحسين المستمر لاستراتيجيات إدارة الأصول
- الورشة الختامية: إعداد وعرض استراتيجية متقدمة لإدارة الأصول تشمل الأهداف الاستثمارية وتخصيص الأصول والتنويع وإدارة المخاطر والسيولة والاستثمارات البديلة واختبارات الضغط وقياس الأداء وإعادة التوازن والحوكمة وخطة التنفيذ

للتسجيل أو لطلب مزيد من المعلومات

صفحة الدورة: <https://quest-training.com/courses/advanced-asset-management-strategies-training-course>

الموقع الإلكتروني: <https://quest-training.com>

البريد الإلكتروني: info@quest-training.com

الهاتف: +905016771440