

رقم الدورة 1552

دورة تخصيص الأصول وبناء المحافظ الاستثمارية

إدارة الثروات والخدمات المصرفية الخاصة
التمويل والاستثمار والخدمات المصرفية

طريقة التقديم

حضور

المدة

5 أيام



نظرة عامة على الدورة

تقدم دورة تخصيص الأصول وبناء المحافظ الاستثمارية إطاراً مهنيًا متقدماً لتصميم وتقييم وإدارة المحافظ الاستثمارية بما يتوافق مع أهداف المستثمر ومستوى تحمله للمخاطر وأفق الاستثمار واحتياجاته من السيولة. وتركز الدورة على الانتقال من التركيز على اختيار الاستثمارات الفردية إلى بناء محفظة متكاملة تحقق التوازن بين العائد المتوقع والمخاطر والتنويع والأهداف الاستثمارية طويلة الأجل.

يمثل تخصيص الأصول أحد أهم القرارات الاستراتيجية في إدارة المحافظ، نظراً لدوره في تحديد كيفية توزيع رأس المال بين فئات الأصول المختلفة وفقاً لأهداف المستثمر ومستوى المخاطر المقبول. وتتناول الدورة تخصيص الاستراتيجي والتكتيكي للأصول، وخصائص الأسهم وأدوات الدخل الثابت والنقد وما يعادله والأصول الحقيقية والاستثمارات البديلة، إضافة إلى العلاقة بين ارتباط الأصول والتنويع والمخاطر والعوائد المتوقعة.

توفر الدورة منهجية عملية لبناء المحافظ الاستثمارية متعددة الأصول. ويتعلم المشاركون كيفية تحديد التوزيع المستهدف للأصول، وتقييم العوائد المتوقعة والمخاطر، واختيار الاستثمارات المناسبة، وإدارة التركيز والتعرضات الاستثمارية، وإدماج احتياجات السيولة والقيود الاستثمارية في عملية تصميم المحفظة. كما تتناول كيفية بناء المحافظ وفقاً لمستويات مختلفة من المخاطر والأهداف، بما في ذلك تحقيق النمو وتوليد الدخل والحفاظ على رأس المال وتحقيق التوازن بين الأهداف الاستثمارية المختلفة.

وتشكل إدارة مخاطر المحافظ أحد المحاور الرئيسية للدورة، حيث يتعرف المشاركون على مخاطر السوق والسيولة والائتمان والتركيز وغيرها من المخاطر المرتبطة بالمحافظ الاستثمارية. كما يتدربون على استخدام تحليل السيناريوهات واختبارات التحمل لتقييم قدرة المحافظ على مواجهة ظروف السوق المختلفة، إلى جانب مراقبة الأداء واختيار المعايير المرجعية وتطبيق أساليب إعادة التوازن للحفاظ على توافق المحفظة مع الأهداف الاستثمارية.

ومن خلال دراسات الحالة وتمارين بناء المحافظ والتحليل الكمي وسيناريوهات الأسواق وورش العمل التطبيقية، تساعد دورة تخصيص الأصول وبناء المحافظ الاستثمارية المشاركين على تطوير قدرات أكثر انضباطاً في اتخاذ القرارات الاستثمارية. وتوفر الدورة قيمة عملية للمهنيين العاملين في إدارة الاستثمار وإدارة الأصول وإدارة الثروات والخدمات المصرفية الخاصة والاستشارات الاستثمارية والاستثمار المؤسسي، ممن يشاركون في تصميم المحافظ أو تقييمها أو مراقبتها.

أهداف الدورة

- تحليل أهداف المستثمر وأفق الاستثمار واحتياجاته من السيولة ومستوى تحمله للمخاطر والقيود الاستثمارية خلال فترة الدورة.
- تطوير إطار متكامل لتخصيص الأصول يربط بين أهداف الاستثمار والعوائد المتوقعة ومستويات المخاطر المقبولة.
- تقييم خصائص فئات الأصول الرئيسية وتحديد أدوارها الاستراتيجية ضمن المحافظ الاستثمارية المتنوعة.
- تطبيق مبادئ التخصيص الاستراتيجي للأصول عند تصميم محافظ استثمارية طويلة الأجل.
- تطبيق أساليب التخصيص التكتيكي للأصول عند تقييم التغيرات في ظروف الأسواق والفرص الاستثمارية.
- تصميم محافظ استثمارية متنوعة ومتعددة الأصول تحقق توازناً مناسباً بين العائد المتوقع والمخاطر والسيولة والتركيز.
- تقييم الارتباطات بين فئات الأصول وتحليل أثر التنوع على مستوى المخاطر الإجمالية للمحفظة.
- تقييم مخاطر السوق والسيولة والائتمان والتركيز والمخاطر المرتبطة بالمحفظة باستخدام أساليب تحليل منظمة.
- تطبيق تحليل السيناريوهات واختبارات التحمل لتقييم قدرة المحافظ على الصمود في ظروف السوق المختلفة.
- تقييم أداء المحافظ الاستثمارية مقارنة بالأهداف الاستثمارية والمعايير المرجعية وتحديد الانحرافات المهمة.
- تطوير منهجيات عملية لإعادة توازن المحافظ والمحافظة على التخصيص المستهدف للأصول.
- إعداد وتقديم استراتيجية متكاملة لتخصيص الأصول وبناء المحافظ الاستثمارية في نهاية الدورة.

الفئة المستهدفة

تستهدف دورة تخصيص الأصول وبناء المحافظ الاستثمارية المهنيين العاملين في إدارة الاستثمار وإدارة الأصول وإدارة الثروات والخدمات المصرفية الخاصة والاستشارات الاستثمارية والاستثمار المؤسسي. وتشمل الفئات

المستهدفة مديري المحافظ، ومديري الاستثمار، ومديري الأصول، والمحللين الاستراتيجيين، ومستشاري الاستثمار، والمستشارين الماليين، ومديري الثروات، والمصرفيين الخاصين، ومتخصصي المنتجات الاستثمارية، والمهنيين العاملين في وضع استراتيجيات المحافظ واتخاذ القرارات الاستثمارية.

كما تناسب الدورة المتخصصين في المؤسسات المالية وشركات الاستثمار وإدارة الأصول وإدارات الاستثمار المؤسسي والخزينة وإدارة المخاطر ممن يشاركون في تصميم المحافظ أو تحليل الاستثمارات أو مراقبة الأداء أو الإشراف على المخاطر. ويمكن للمهنيين المسؤولين عن تقييم الاستراتيجيات الاستثمارية ودعم قرارات تخصيص الأصول الاستفادة من المنهجيات العملية المتقدمة التي تتناولها الدورة.

وتناسب الدورة أيضاً كبار التنفيذيين ومديري الاستثمار ورؤساء إدارات الاستثمار وقادة إدارة المحافظ ومديري إدارة الأصول ومديري إدارة الثروات وصناع القرار المسؤولين عن تطوير الأطر الاستثمارية وحوكمة المحافظ. كما تفيد القيادات التي تسعى إلى تعزيز إدارة المخاطر وتحسين آليات اتخاذ القرار الاستثماري وتطوير منهجيات أكثر انضباطاً لتخصيص الأصول وبناء المحافظ ومتابعة الأداء.

مخرجات التعلم

- تحليل أهداف المستثمر واحتياجاته المالية والاستثمارية والقيود المؤثرة في تصميم المحفظة.
- تقييم مستوى تحمل المستثمر للمخاطر وربطه بالأهداف الاستثمارية والاستراتيجية المناسبة للمحفظة.
- تقييم خصائص الأسهم وأدوات الدخل الثابت والنقد والأصول الحقيقية والاستثمارات البديلة.
- تحديد الدور الاستراتيجي لفئات الأصول المختلفة ضمن المحافظ الاستثمارية المتنوعة.
- تطبيق مبادئ التخصيص الاستراتيجي والتكتيكي للأصول وفق أهداف المحفظة وظروف الأسواق.
- بناء محافظ استثمارية متعددة الأصول باستخدام مبادئ التخصيص والتنويع وإدارة المخاطر.
- تحليل الارتباطات بين الأصول وتقييم تأثيرها على تنويع المحفظة ومستوى المخاطر الإجمالي.
- تحديد وتقييم مخاطر السوق والسيولة والائتمان والتركيز وغيرها من المخاطر الاستثمارية.
- تطبيق تحليل السيناريوهات واختبارات التحمل لتقييم قدرة المحفظة على مواجهة ظروف السوق المختلفة.

- قياس أداء المحافظ باستخدام مؤشرات مناسبة للعائد والمخاطر والمعايير المرجعية.
- تحديد الانحرافات عن التخصيص المستهدف للأصول وتطوير توصيات مناسبة لإعادة توازن المحفظة.
- إعداد وتقديم استراتيجية متكاملة لتخصيص الأصول وبناء المحافظ استناداً إلى أهداف استثمارية ومستويات مخاطر محددة.
- المحاوور التدريبية:

محاوور الدورة

اليوم الأول

أسس تخصيص الأصول وإدارة المحافظ الاستثمارية

- فهم دور تخصيص الأصول في إدارة المحافظ الاستثمارية
- العلاقة بين تخصيص الأصول والعائد المتوقع والمخاطر الاستثمارية
- تحديد أهداف المستثمر والأفق الزمني للاستثمار
- تقييم احتياجات السيولة والدخل والحفاظ على رأس المال والنمو
- تقييم تحمل المخاطر والقدرة على تحمل المخاطر
- فهم القيود الاستثمارية والعوامل المؤثرة في تصميم المحافظ
- مبادئ التنويع الاستثماري
- العلاقة بين ارتباط الأصول والتنويع ومخاطر المحفظة
- التمييز بين تخصيص الأصول واختيار الأوراق والأدوات الاستثمارية الفردية
- الأهمية الاستراتيجية لتخصيص الأصول في إدارة المحافظ طويلة الأجل
- التطبيق العملي: تحليل ملف مستثمر وتطوير إطار أولي لتخصيص الأصول

اليوم الثاني

فئات الأصول والتخصيص الاستراتيجي للأصول

- خصائص الأسهم وأدوارها الاستثمارية
- أدوات الدخل الثابت وخصائص العائد والمخاطر
- النقد وما يعادله وإدارة السيولة
- الأصول الحقيقية والاستثمارات البديلة
- تقييم العوائد المتوقعة لفئات الأصول المختلفة
- تقييم خصائص المخاطر والارتباطات بين فئات الأصول
- أطر التخصيص الاستراتيجي للأصول
- تحديد التوزيعات المستهدفة للمحفظة
- تصميم المحافظ لمستويات مختلفة من المخاطر
- موازنة تخصيص الأصول مع الأهداف الاستثمارية
- التطبيق العملي: تطوير تخصيص استراتيجي لمحفظة استثمارية متنوعة ومتعددة الأصول

اليوم الثالث

بناء المحافظ وإدارة المخاطر الاستثمارية

- مبادئ بناء المحافظ متعددة الأصول
- اختيار الاستثمارات ضمن فئات الأصول المختلفة
- التنوع حسب القطاعات والأسواق والمناطق وفئات الأصول
- إدارة التركيز والتعرضات الاستثمارية
- تقييم وإدارة مخاطر السوق
- إدارة مخاطر السيولة والائتمان

اليوم الثالث — تابع

- تقييم المخاطر على مستوى المحفظة
- فهم العلاقة بين التقلب والمخاطر والعائد المتوقع
- تحليل السيناريوهات واختبارات التحمل للمحافظ
- تقييم قدرة المحفظة على مواجهة التغيرات في ظروف الأسواق
- التطبيق العملي: بناء محفظة استثمارية وتحليل تعرضاتها للمخاطر وخصائص التنوع فيها

اليوم الرابع

التخصيص التكتيكي وقياس أداء المحافظ

- فهم مفهوم التخصيص التكتيكي للأصول
- الفروق بين القرارات الاستثمارية الاستراتيجية والتكتيكية
- تقييم ظروف الأسواق والفرص الاستثمارية
- تعديل تخصيص الأصول استجابة للتغيرات في بيئة الأسواق
- إدارة الانحرافات عن التخصيص المستهدف للأصول
- مبادئ قياس أداء المحافظ الاستثمارية
- تحليل العائد والمخاطر
- اختيار المعايير المرجعية المناسبة لقياس الأداء
- تحليل مصادر أداء المحفظة
- تقييم نتائج المحفظة مقارنة بالأهداف الاستثمارية
- التطبيق العملي: تحليل محفظة قائمة وتقييم أدائها وتحديد فرص التحسين

اليوم الخامس

إعادة توازن المحافظ والاستراتيجية الاستثمارية المتكاملة

- مبادئ وأهداف إعادة توازن المحافظ
- تحديد حدود الانحراف التي تستدعي إعادة التوازن
- أساليب إعادة التوازن القائمة على الزمن والقواعد وظروف الأسواق
- إدارة المحافظ خلال فترات تقلب الأسواق
- مراجعة تخصيص الأصول عند تغير أهداف المستثمر
- دمج إدارة المخاطر ضمن عملية بناء المحافظ
- تطوير أطر مراقبة ومراجعة المحافظ
- مؤشرات الأداء الرئيسية للمحافظ الاستثمارية
- توثيق قرارات تخصيص الأصول وإدارة المحافظ
- أفضل الممارسات في بناء المحافظ متعددة الأصول
- ورشة العمل النهائية: تصميم وتقديم استراتيجية متكاملة لتخصيص الأصول وبناء المحافظ تشمل أهداف المستثمر ومستوى المخاطر والتخصيص الاستراتيجي والتكتيكي والتنويع وإدارة المخاطر وقياس الأداء وإعادة التوازن

للتسجيل أو لطلب مزيد من المعلومات

صفحة الدورة: <https://quest-training.com/courses/asset-allocation-portfolio-construction-training-course>

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

البريد الإلكتروني: info@quest-training.com

الهاتف: +905016771440