

رقم الدورة 1055

المشتقات المالية واستراتيجيات التحوط

الخزينة والأسواق المالية
التمويل والاستثمار والخدمات المصرفية

طريقة التقديم

حضور

التواريخ

٠٣ نوفمبر - ٤ ديسمبر ٢٠٢٢

المدة

5 أيام

المكان

المنامة، البحرين



تفاصيل الموعد المجدول

المدينة	المنامة، البحرين
التاريخ	٠٣ نوفمبر – ٠٤ ديسمبر ٢٠٢٢
طريقة التقديم	حضوري
رسوم الدورة	€ ٠٧,٤٠

نظرة عامة على الدورة

تُعد دورة المشتقات المالية واستراتيجيات التحوط من البرامج التدريبية المتقدمة التي تهدف إلى تزويد العاملين في البنوك والمؤسسات المالية بالمعارف والمهارات اللازمة لفهم المشتقات المالية واستخدامها بفاعلية في إدارة المخاطر المالية والتحوط ضد تقلبات الأسواق. ومع تزايد التقلبات في أسعار الفائدة، وأسعار الصرف، وأسعار السلع، وأسواق رأس المال، أصبحت المشتقات المالية من أهم الأدوات التي تعتمد عليها المؤسسات المالية لحماية أصولها، وتعزيز استقرارها المالي، وتحقيق التوازن بين المخاطر والعوائد.

يركز البرنامج على بناء فهم متكامل لأنواع المشتقات المالية، بما في ذلك العقود الآجلة (Forwards)، والعقود المستقبلية (Futures)، والمبادلات (Swaps)، والخيارات (Options)، مع توضيح خصائص كل أداة، وآليات تسعيرها، واستخداماتها العملية في التحوط وإدارة المخاطر. كما يتناول البرنامج المبادئ الأساسية لتقييم المشتقات المالية، وآليات تنفيذ الصفقات، وتسويتها، وإدارة الضمانات، بما يدعم اتخاذ قرارات مالية واستثمارية أكثر كفاءة. كما يستعرض البرنامج استراتيجيات التحوط ضد مخاطر أسعار الفائدة، ومخاطر أسعار الصرف، ومخاطر أسعار السلع، ومخاطر السوق، ومخاطر المحافظ الاستثمارية، إضافة إلى قياس فعالية التحوط، وإدارة مخاطر الطرف المقابل، وتحليل المخاطر المتبقية، واختبارات الضغط، وتحليل السيناريوهات، مع التركيز على متطلبات الحوكمة والرقابة والامتثال التنظيمي، وأفضل الممارسات الدولية في استخدام المشتقات المالية.

ومن خلال التطبيقات العملية ودراسات الحالة الواقعية، سيتمكن المشاركون من تقييم التعرض للمخاطر، واختيار أدوات التحوط المناسبة، وتصميم استراتيجيات تحوط فعالة، وتحليل نتائجها، وإعداد التقارير التنفيذية، وتعزيز

التكامل بين إدارة الخزينة، وإدارة المخاطر، وإدارة الأصول والخصوم، والاستثمار، بما يسهم في تعزيز الاستقرار المالي وتحقيق الأهداف الاستراتيجية للمؤسسة.

أهداف الدورة

- تحليل مبادئ المشتقات المالية واستراتيجيات التحوط وتقييم تطبيقها في المؤسسات المالية بنهاية البرنامج.
- تطوير فهم شامل لأنواع المشتقات المالية وآليات استخدامها في إدارة المخاطر.
- تقييم التعرض لمخاطر أسعار الفائدة، وأسعار الصرف، وأسعار السلع، ومخاطر السوق.
- تطبيق منهجيات تسعير وتقييم المشتقات المالية وفق أفضل الممارسات المالية.
- تصميم استراتيجيات تحوط فعالة باستخدام العقود الآجلة، والعقود المستقبلية، والمبادلات، والخيارات.
- تحسين إدارة المخاطر من خلال قياس فعالية التحوط، وتحليل السيناريوهات، واختبارات الضغط.
- تعزيز الحوكمة والرقابة من خلال تطوير السياسات والإجراءات الخاصة باستخدام المشتقات المالية.
- تنفيذ مؤشرات الأداء ومؤشرات المخاطر الرئيسية لمراقبة كفاءة استراتيجيات التحوط.
- تقييم التحديات الناشئة المرتبطة بالتكنولوجيا المالية، والتداول الإلكتروني، والتغيرات التنظيمية، وتقلبات الأسواق.
- مواصلة استخدام المشتقات المالية مع إدارة الخزينة، وإدارة الأصول والخصوم، وإدارة المخاطر المؤسسية قبل نهاية الدورة.

الفئة المستهدفة

تستهدف هذه الدورة مدراء الخزينة، ومدراء إدارة المخاطر، ومدراء مخاطر السوق، ومدراء الاستثمار، ومدراء المحافظ الاستثمارية، ومدراء إدارة الأصول والخصوم، ومدراء الأسواق المالية، ومدراء السيولة، والمتعاملين في الأسواق المالية، ومحلي الاستثمار، ومحلي المخاطر، ومحلي الخزينة، والعاملين في إدارات الاستثمار والخزينة

وإدارة المخاطر بالمؤسسات المالية.

كما تناسب الرؤساء التنفيذيين للشؤون المالية، والرؤساء التنفيذيين للمخاطر، والرؤساء التنفيذيين للاستثمار، وأعضاء لجنة إدارة الأصول والخصوم (ALCO)، وأعضاء لجان المخاطر والاستثمار، والعاملين في البنوك المركزية، وشركات الاستثمار، وشركات إدارة الأصول، وشركات التأمين، وشركات الوساطة المالية، والمؤسسات المالية، وجميع المهنيين المسؤولين عن إدارة المحافظ، والاستثمار، والخزينة، وإدارة المخاطر، والتخطيط المالي.

مخرجات التعلم

- بنهاية الدورة سيكون المشاركون قادرين على:
- بناء إطار متكامل لاستخدام المشتقات المالية في إدارة المخاطر والتحوط.
- تقييم التعرض للمخاطر واختيار أدوات التحوط المناسبة لكل حالة.
- تطبيق أساليب تسعير وتقييم العقود الآجلة، والعقود المستقبلية، والمبادلات، والخيارات.
- تصميم استراتيجيات تحوط فعالة ضد مخاطر أسعار الفائدة، وأسعار الصرف، وأسعار السلع، ومخاطر السوق.
- قياس فعالية التحوط باستخدام التحليلات الكمية واختبارات الضغط وتحليل السيناريوهات.
- تطوير سياسات وضوابط داخلية لإدارة عمليات المشتقات المالية والرقابة عليها.
- إعداد تقارير احترافية للإدارة العليا حول أداء استراتيجيات التحوط ومؤشرات المخاطر.
- دمج استراتيجيات التحوط مع إدارة الخزينة، وإدارة الأصول والخصوم، وإدارة المخاطر المؤسسية.
- تقييم أثر التطورات الاقتصادية والتكنولوجية على أسواق المشتقات المالية.
- إعداد خطة تنفيذية لتعزيز استخدام المشتقات المالية واستراتيجيات التحوط بما يدعم الاستقرار المالي والاستدامة المؤسسية.

محاوّر الدورة

المحتوى التدريبي:

اليوم الأول

أساسيات المشتقات المالية وإدارة المخاطر

- مفهوم المشتقات المالية وأهميتها.
- أنواع المشتقات المالية والمشاركون في السوق.
- دور المشتقات في إدارة المخاطر.
- الإطار التنظيمي وأفضل الممارسات الدولية.
- تطبيق عملي: تحديد المخاطر المالية المناسبة للتحوط.

اليوم الثاني

أدوات المشتقات المالية وتقييمها

- العقود الآجلة (Forwards).
- العقود المستقبلية (Futures).
- المبادلات (Swaps).
- الخيارات (Options).
- تطبيق عملي: تقييم وتسعير أدوات المشتقات المالية.

اليوم الثالث

استراتيجيات التحوط وإدارة المخاطر

- التحوط من مخاطر أسعار الفائدة.
- التحوط من مخاطر أسعار الصرف.

اليوم الثالث — تابع

- التحوط من مخاطر أسعار السلع ومخاطر السوق.
- قياس فعالية التحوط وإدارة المخاطر المتبقية.
- تطبيق عملي: تصميم استراتيجية تحوط متكاملة لمحفظه مالية.

اليوم الرابع

الحوكمة والرقابة والامتثال

- سياسات استخدام المشتقات المالية.
- الضوابط الداخلية وإدارة الضمانات.
- الامتثال التنظيمي وإعداد التقارير.
- اختبارات الضغط وتحليل السيناريوهات.
- تطبيق عملي: إعداد إطار حوكمة ورقابة لعمليات المشتقات المالية.

اليوم الخامس

التميز في استخدام المشتقات المالية واستراتيجيات التحوط

- أفضل الممارسات العالمية في إدارة المشتقات المالية.
- التكامل بين إدارة الخزينة، وإدارة الأصول والخصوم، وإدارة المخاطر.
- التحول الرقمي والتكنولوجيا المالية في أسواق المشتقات.
- التحسين المستمر ورفع كفاءة استراتيجيات التحوط.
- الورشة الختامية: إعداد خطة تنفيذ متكاملة لاستخدام المشتقات المالية واستراتيجيات التحوط، تشمل تحليل التعرض للمخاطر، واختيار أدوات المشتقات المناسبة، وتصميم استراتيجيات التحوط، وقياس فعاليتها، وإجراء اختبارات الضغط، وتعزيز الحوكمة والرقابة، وإعداد التقارير التنفيذية، وآليات المتابعة والتحسين المستمر، بما يدعم الاستقرار المالي، ويعزز الامتثال للمتطلبات التنظيمية، ويحسن كفاءة إدارة المخاطر، ويحقق الاستدامة المؤسسية.



للتسجيل أو لطلب مزيد من المعلومات

صفحة الدورة: <https://quest-training.com/courses/derivatives-hedging-strategies>

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

البريد الإلكتروني: info@quest-training.com

الهاتف: +905016771440

