

رقم الدورة 1474

دورة تحليل الاستثمارات وإدارة المحافظ الاستثمارية

إدارة الاستثمار والأصول
التمويل والاستثمار والخدمات المصرفية

طريقة التقديم

حضور

المدة

5 أيام



نظرة عامة على الدورة

تقدم دورة تحليل الاستثمارات وإدارة المحافظ الاستثمارية إطاراً مهنيّاً متقدماً وعمليّاً لتقييم الفرص الاستثمارية وتحليل الأدوات المالية وبناء المحافظ المتنوعة وإدارة المخاطر ومتابعة الأداء الاستثماري. وتهدف الدورة إلى تعزيز قدرة المشاركين على اتخاذ قرارات استثمارية منهجية تستند إلى التحليل المالي والتقييم وظروف الأسواق ومستويات المخاطر وأهداف الاستثمار طويلة الأجل.

يتطلب التحليل الاستثماري الفعال أكثر من دراسة العوائد التاريخية، إذ يجب تقييم الأداء المالي للشركات وقوة الأعمال والتقييم السوقي والسيولة والظروف الاقتصادية ومخاطر السوق والعلاقة بين العائد المتوقع ومستوى المخاطر. وتوفر الدورة منهجية متكاملة لتحليل الأسهم وأدوات الدخل الثابت وغيرها من الفرص الاستثمارية، مع الجمع بين العوامل الكمية والنوعية في عملية اتخاذ القرار.

يتناول البرنامج أساليب التحليل والتقييم الاستثماري، بما يشمل تحليل القوائم المالية، وتحليل الشركات والقطاعات، وتقييم الأسهم، وتحليل أدوات الدخل الثابت، وتحليل العائد والمخاطر، وتخصيص الأصول، والتنويع، وبناء المحافظ، وقياس الأداء. كما يوضح كيفية تحديد الفرص الاستثمارية الجاذبة وتقييم القيمة العادلة ومقارنة البدائل وتحديد مدى توافق الاستثمار مع أهداف المحفظة وقيود المخاطر والسيولة.

ويركز البرنامج بصورة خاصة على إدارة المحافظ وتحويل نتائج تحليل الاستثمارات الفردية إلى استراتيجية محفظة متكاملة. ويتناول التخصيص الاستراتيجي والتكتيكي للأصول، والتنويع والارتباط بين الأصول، ومخاطر التركز والتقلب والسيولة، وإعادة التوازن، والقيود الاستثمارية، واختيار المؤشرات المرجعية. كما يغطي متابعة أداء المحافظ وتحليل مساهمة القرارات الاستثمارية وتعديل مكونات المحفظة وفق تغيرات السوق وأهداف الاستثمار.

ومن خلال دراسات الحالة والتمارين التحليلية وتقييم الأسهم والسندات وبناء المحافظ وتحليل المخاطر وورش قياس الأداء، تساعد دورة تحليل الاستثمارات وإدارة المحافظ الاستثمارية المشاركين على تطوير مهارات عملية قابلة للتطبيق في البنوك وشركات الاستثمار وإدارة الأصول والمكاتب العائلية والمستثمرين المؤسسيين والجهات الحكومية والشركات الكبرى. وتناسب الدورة المديرين التنفيذيين ومديري المحافظ والمحللين الماليين ومتخصصي الخزينة والمخاطر وصناع القرار المسؤولين عن الاستثمار وتخصيص رأس المال.

أهداف الدورة

- تحليل المبادئ الأساسية لتحليل الاستثمارات وإدارة المحافظ ودورها في تخصيص رأس المال خلال فترة الدورة.
- تقييم القوائم المالية والأداء التشغيلي والقطاعات والظروف الاقتصادية عند دراسة الفرص الاستثمارية.
- تطبيق أساليب التحليل والتقييم المالي لتحديد القيمة والجاذبية الاستثمارية للأدوات المختلفة.
- تطوير منهجيات عملية لتحليل الأسهم وأدوات الدخل الثابت والفرص الاستثمارية المتنوعة.
- تقييم العائد المتوقع والمخاطر والسيولة والظروف السوقية عند اتخاذ القرار الاستثماري.
- تصميم محافظ استثمارية متنوعة وفق أهداف الاستثمار وتحمل المخاطر والأفق الزمني واحتياجات السيولة.
- تطبيق مبادئ تخصيص الأصول والتنويع والارتباط بين الأصول لتحسين هيكل المحفظة.
- تقييم أداء المحافظ الاستثمارية مقارنة بالأهداف ومؤشرات المرجعية المناسبة.
- تحليل مخاطر المحفظة بما يشمل التركيز والتقلب والسيولة والتعرض لتغيرات الأسواق.
- تطوير آليات عملية لإعادة توازن المحافظ استناداً إلى تغيرات السوق والمخاطر والأهداف الاستثمارية.
- تحسين التقارير الاستثمارية ودعم القرارات التنفيذية باستخدام مؤشرات الأداء والمخاطر ومساهمة القرارات الاستثمارية.
- مواءمة تحليل الاستثمارات وإدارة المحافظ مع الحوكمة وإدارة المخاطر والمسؤوليات الائتمانية والأهداف الاستثمارية طويلة الأجل.

الفئة المستهدفة

تستهدف هذه الدورة المهنيين العاملين في إدارة الاستثمار وإدارة المحافظ وإدارة الأصول والخزينة والتحليل المالي والتمويل المؤسسي وإدارة المخاطر. وتشمل الفئات المستهدفة مديري المحافظ، ومديري الاستثمار، ومحلي الاستثمار، ومحلي الأسهم، ومحلي الدخل الثابت، ومتخصصي الخزينة، والمحليلين الماليين، ومتخصصي تخصيص الأصول، ومديري المخاطر، والمهنيين المسؤولين عن تقييم الأوراق المالية وإدارة المحافظ الاستثمارية.

كما تناسب الرؤساء التنفيذيين والمديرين الماليين ومديري الاستثمار ورؤساء إدارة الأصول ومديري الخزينة وأعضاء لجان الاستثمار وصناع القرار المسؤولين عن تخصيص رأس المال والاستراتيجية الاستثمارية والسيولة وأداء المحافظ. ويمكن أن يستفيد منها العاملون في الجهات الحكومية والوزارات والمؤسسات السيادية والبنوك والمؤسسات المالية وصناديق الاستثمار والمستثمرين المؤسسيين وقطاعات النفط والغاز والشركات الكبرى. وتوفر الدورة قيمة خاصة للمهنيين المشاركين في أبحاث الاستثمار واختيار الأوراق المالية وبناء المحافظ وتخصيص الأصول وإعداد سياسات الاستثمار ومراقبة المخاطر وتقارير الأداء والمراجعات الاستثمارية الاستراتيجية. كما تناسب المتخصصين في التدقيق الداخلي والحوكمة والامتثال والمالية الذين يحتاجون إلى فهم أعمق لعمليات اتخاذ القرار الاستثماري وإدارة مخاطر المحافظ.

مخرجات التعلم

- شرح المبادئ الأساسية لتحليل الاستثمارات وإدارة المحافظ الاستثمارية.
- تحليل القوائم المالية والأسس الاقتصادية والتشغيلية لتقييم جودة الشركات والفرص الاستثمارية.
- تقييم الأسهم وأدوات الدخل الثابت باستخدام أساليب التحليل والتقييم المناسبة.
- تقييم الفرص الاستثمارية وفق العائد المتوقع والقيمة والمخاطر والسيولة وظروف السوق.
- تحديد العلاقة بين أهداف الاستثمار وتحمل المخاطر والأفق الزمني وهيكل المحفظة.
- بناء محافظ استثمارية متنوعة باستخدام أساليب مناسبة لتخصيص الأصول واختيار الأوراق المالية.
- تحليل الارتباط والتركيز والتقلب ومصادر المخاطر المختلفة داخل المحفظة.
- تقييم أداء المحافظ مقارنة بالمؤشرات المرجعية والأهداف الاستثمارية المحددة.
- تطبيق أساليب إعادة توازن المحافظ للحفاظ على التخصيص المستهدف ومستويات المخاطر.
- إجراء تحليل السيناريوهات واختبارات الضغط لتقييم مرونة المحفظة أمام تغيرات الأسواق.
- إعداد تقارير استثمارية وإدارية واضحة تدعم الإدارة العليا ولجان الاستثمار.

- تطوير استراتيجية متكاملة لإدارة المحافظ تتوافق مع الحوكمة والسيولة وإدارة المخاطر والأهداف الاستثمارية طويلة الأجل.
- المحاوّر التدريبية:

محاوّر الدورة

اليوم الأول

أسس تحليل الاستثمارات وتقييم الأسواق المالية

- مبادئ وأهداف تحليل الاستثمارات
- عملية اتخاذ القرار الاستثماري وسياسات الاستثمار
- العلاقة بين العائد والمخاطر والسيولة والأفق الزمني
- نظرة شاملة على فئات الأصول والأدوات المالية
- العوامل الاقتصادية الكلية المؤثرة في الأسواق
- تحليل القطاعات والصناعات
- تقييم نموذج الأعمال والمركز التنافسي وجودة الإدارة
- تحليل القوائم المالية والمؤشرات الاستثمارية الرئيسية
- التطبيق العملي: تحليل فرصة استثمارية باستخدام المعلومات المالية والاقتصادية والقطاعية ومعلومات الشركة

اليوم الثاني

تحليل الأوراق المالية والتقييم واختيار الاستثمارات

- تحليل الأسهم وأساليب البحث الأساسي
- تحليل الإيرادات والأرباح والتدفقات النقدية والميزانية

اليوم الثاني — تابع

- النسب المالية والتحليل المقارن
- مفهوم القيمة العادلة والقيمة النسبية
- التقييم باستخدام التدفقات النقدية المخصومة
- مضاعفات التقييم وأساليب المقارنة السوقية
- تحليل أدوات الدخل الثابت والجودة الائتمانية والاستحقاق والعائد
- المدد والحساسية لأسعار الفائدة ومخاطر الائتمان
- التطبيق العملي: تقييم فرص استثمارية في الأسهم وأدوات الدخل الثابت وإعداد توصية استثمارية وفق القيمة والمخاطر

اليوم الثالث

بناء المحافظ وتخصيص الأصول والتنويع

- مبادئ إدارة المحافظ الاستثمارية
- التخصيص الاستراتيجي والتكتيكي للأصول
- أهداف الاستثمار وتحمل المخاطر والقيود الاستثمارية
- التنويع والارتباط بين الأصول
- بناء المحافظ واختيار الأوراق المالية
- إدارة التركز والتعرضات
- المفاضلة بين العائد والمخاطر وكفاءة المحفظة
- احتياجات السيولة والأفق الزمني
- مفاهيم تحسين المحافظ وقرارات التخصيص
- التطبيق العملي: بناء محفظة استثمارية متنوعة وفق أهداف محددة وتحمل المخاطر واحتياجات السيولة والقيود الاستثمارية

اليوم الرابع

إدارة مخاطر المحافظ ومتابعتها وإعادة توازنها

- تحديد وقياس مخاطر المحافظ
- مخاطر السوق والائتمان والسيولة والتركيز والعمليات
- تحليل التقلبات والانخفاضات والمخاطر السلبية
- تحليل السيناريوهات واختبارات الضغط
- مراقبة التعرضات وحدود الاستثمار
- اختيار المؤشرات المرجعية ومتابعة الأداء
- مبادئ إعادة توازن المحافظ ومحفظاتها
- تعديل الاستراتيجية وفق تغيرات الأسواق
- الحوكمة والضوابط الاستثمارية
- التطبيق العملي: إجراء مراجعة لمخاطر محفظة استثمارية وإعداد استراتيجية لإعادة التوازن وفق تغيرات السوق والتعرضات

اليوم الخامس

تقييم أداء المحافظ والاستراتيجية الاستثمارية التنفيذية

- قياس وتقييم أداء المحافظ الاستثمارية
- تحليل الأداء المطلق والنسبي
- مقارنة الأداء بالمؤشرات المرجعية
- تحليل مساهمة قرارات اختيار الأوراق المالية وتخصيص الأصول
- مفاهيم قياس الأداء المعدل حسب المخاطر
- إعداد التقارير الاستثمارية للإدارة العليا ولجان الاستثمار

اليوم الخامس — تابع

- تطوير لوحات متابعة ومؤشرات أداء للمحافظ
- مراجعة سياسات وأهداف الاستثمار
- دمج توقعات الأسواق مع تحليل المخاطر واستراتيجية المحفظة
- الورشة الختامية: إعداد وعرض استراتيجية متكاملة لتحليل الاستثمارات وإدارة المحافظ تشمل أهداف الاستثمار وتحليل الأسواق واختيار الأوراق المالية والتقييم وتخصيص الأصول والتنويع وإدارة المخاطر وقياس الأداء وإعادة التوازن والحوكمة والتوصيات التنفيذية

للتسجيل أو لطلب مزيد من المعلومات

صفحة الدورة:

<https://quest-training.com/courses/investment-analysis-portfolio-management-training-course>

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

البريد الإلكتروني: info@quest-training.com

الهاتف: +905016771440