

رقم الدورة 1488

دورة إدارة مخاطر الاستثمار وقياس الأداء

إدارة الاستثمار والأصول
التمويل والاستثمار والخدمات المصرفية

طريقة التقديم

حضور

المدة

5 أيام



نظرة عامة على الدورة

تقدم دورة إدارة مخاطر الاستثمار وقياس الأداء إطارًا مهنيًا متكاملًا لتحديد مخاطر الاستثمار وتقييمها ومراقبتها وإدارتها، إلى جانب قياس أداء المحافظ الاستثمارية مقارنة بالأهداف الاستثمارية والمعايير المرجعية المحددة. وتُعد الإدارة الفعالة لمخاطر الاستثمار عنصرًا أساسيًا للمؤسسات التي تسعى إلى حماية رأس المال والحفاظ على مستويات مناسبة من التعرض للمخاطر واتخاذ قرارات استثمارية منضبطة في ظل تغيرات الأسواق.

تتناول الدورة أهم مصادر مخاطر الاستثمار، بما في ذلك مخاطر السوق، ومخاطر أسعار الفائدة، ومخاطر الائتمان، ومخاطر السيولة، ومخاطر العملات، ومخاطر التركز، ومخاطر التضخم، والمخاطر التشغيلية. ويطور المشاركون فهمًا منهجيًا لكيفية تأثير هذه المخاطر على الأوراق المالية الفردية والمحافظ الاستثمارية وقرارات تخصيص الأصول والأداء الاستثماري المؤسسي.

ويركز البرنامج بصورة رئيسية على قياس الأداء الاستثماري، بما يشمل احتساب العوائد، وتحليل الأداء المعدل حسب المخاطر، واختيار المعايير المرجعية، وتحليل مساهمات مكونات المحفظة في الأداء. كما يتعلم المشاركون كيفية تحليل أثر تخصيص الأصول واختيار الاستثمارات وحركات الأسواق على النتائج الاستثمارية، بما يدعم التقييم الموضوعي لفعالية الاستراتيجيات الاستثمارية.

صُممت دورة إدارة مخاطر الاستثمار وقياس الأداء لتناسب البنوك والمؤسسات المالية وشركات إدارة الأصول والجهات الحكومية والصناديق الاستثمارية وشركات التأمين والمؤسسات الاستثمارية والشركات الكبرى. وتجمع الدورة بين المفاهيم المتخصصة والتطبيقات العملية وتحليل المحافظ، بما يساعد المديرين التنفيذيين ومديري الاستثمار ومديري المحافظ والمحللين الماليين والمتخصصين في المخاطر وصناع القرار على تعزيز إدارة المخاطر وقياس الأداء والحوكمة الاستثمارية.

أهداف الدورة

- تحليل أهم مخاطر الاستثمار وتقييم تأثيرها المحتمل على الأوراق المالية والمحافظ الاستثمارية خلال فترة الدورة.

- تقييم مخاطر السوق والائتمان والسيولة وأسعار الفائدة والعمليات والتركيز والتضخم والمخاطر التشغيلية باستخدام حالات استثمارية عملية.
- تطبيق أساليب كمية ونوعية لتحديد وقياس مستويات التعرض للمخاطر داخل المحافظ الاستثمارية.
- تطوير أساليب عملية لمراقبة مخاطر الاستثمار والحفاظ على مستويات التعرض ضمن الحدود المعتمدة.
- احتساب العوائد الاستثمارية باستخدام أساليب القياس المناسبة وفق طبيعة المحفظة والاستثمار.
- تقييم أداء المحافظ الاستثمارية مقارنة بالأهداف الاستثمارية والمعايير المرجعية ومستويات المخاطر المحددة.
- تطبيق مقاييس الأداء المعدل حسب المخاطر لتقييم مدى تناسب العوائد المحققة مع المخاطر المحتملة.
- تحليل مساهمة تخصيص الأصول واختيار الاستثمارات وحركات الأسواق في الأداء الكلي للمحفظة.
- تصميم أطر عملية لمتابعة المحافظ تجمع بين مؤشرات المخاطر ومقاييس الأداء.
- تقييم فعالية الاستراتيجيات الاستثمارية باستخدام تحليل مساهمات الأداء والمقارنات المناسبة.
- تطوير توصيات لتحسين الأداء المعدل حسب المخاطر مع الحفاظ على القيود والضوابط الاستثمارية.
- تطبيق إطار متكامل لإدارة مخاطر الاستثمار وقياس الأداء بما يتناسب مع متطلبات إدارة المحافظ المؤسسية.

الفئة المستهدفة

تستهدف دورة إدارة مخاطر الاستثمار وقياس الأداء المتخصصين المسؤولين عن إدارة الاستثمارات ومتابعة المحافظ وإدارة المخاطر المالية وتحليل الأداء الاستثماري. وتشمل الفئة المستهدفة مديري الاستثمار، ومديري المحافظ، ومديري المخاطر، ومحلي الاستثمار، والمحليلين الماليين، ومتخصصي قياس الأداء، ومديري الأصول، وموظفي الخزينة، ومتخصصي مخاطر الاستثمار، والعاملين في المؤسسات الاستثمارية وإدارة الأصول.

كما تناسب الدورة المديرين التنفيذيين وكبار المديرين ورؤساء الأقسام وصناع القرار المشاركين في الاستراتيجية الاستثمارية وحوكمة المحافظ والرقابة على المخاطر وتخصيص الأصول وقياس الأداء. ويستفيد منها العاملون في البنوك وشركات الاستثمار وشركات التأمين والصناديق والمؤسسات الاستثمارية والجهات الحكومية

والمؤسسات الاستثمارية المؤسسية والشركات الكبرى.

مخرجات التعلم

- تحديد وتصنيف المخاطر الرئيسية التي تؤثر على المحافظ الاستثمارية.
- تقييم الأثر المالي المحتمل لمخاطر السوق والائتمان والسيولة وأسعار الفائدة والعملة والتركيز.
- تطبيق أساليب عملية لقياس ومتابعة مستويات التعرض للمخاطر داخل المحافظ.
- احتساب عوائد المحافظ الاستثمارية باستخدام أساليب قياس الأداء المناسبة.
- تقييم أداء المحافظ مقارنة بالأهداف الاستثمارية والمعايير المرجعية المناسبة.
- تطبيق مقاييس الأداء المعدل حسب المخاطر لمقارنة الاستراتيجيات والمحافظ الاستثمارية.
- تحليل مساهمة تخصيص الأصول واختيار الاستثمارات في تحقيق عوائد المحفظة.
- إجراء تحليل لمساهمات الأداء لتحديد العوامل الرئيسية المؤثرة في النتائج الاستثمارية.
- تطوير مؤشرات لمتابعة مخاطر وأداء المحافظ وإعداد تقارير مناسبة للإدارة.
- تفسير معلومات المخاطر والأداء لدعم القرارات الاستثمارية.
- تحديد فرص تحسين أداء المحافظ مع الحفاظ على ضوابط إدارة المخاطر.
- إعداد إطار متكامل لإدارة مخاطر الاستثمار وقياس أداء المحافظ المؤسسية.
- المحاور التدريبية:

محاوّر الدورة

اليوم الأول

أساسيات إدارة مخاطر الاستثمار

- مبادئ وأهداف إدارة مخاطر الاستثمار.
- تحديد مخاطر الاستثمار وتصنيفها.
- مخاطر السوق والتعرضات الاستثمارية.
- مخاطر أسعار الفائدة ومنحنى العائد.
- مخاطر الائتمان والتعثر.
- مخاطر السيولة واعتبارات التمويل.
- مخاطر العملات والتضخم.
- مخاطر التركيز والمخاطر التشغيلية.
- تطبيق عملي: تحديد المخاطر وإعداد خريطة للمخاطر داخل محفظة استثمارية متنوعة.

اليوم الثاني

قياس مخاطر الاستثمار ومراقبتها

- الأساليب الكمية والنوعية لتقييم مخاطر الاستثمار.
- قياس التعرضات للمخاطر وحساسية المحافظ.
- تحليل التقلبات ومخاطر الانخفاض.
- القيمة المعرضة للمخاطر وتطبيقاتها العملية.
- اختبارات الضغط وتحليل السيناريوهات.
- تحليل الارتباط والتنويع ومخاطر التركيز.
- قياس ومراقبة مخاطر السيولة.

اليوم الثاني — تابع

- تحديد حدود المخاطر وآليات التصعيد.
- تطبيق عملي: إعداد إطار لتقييم ومراقبة مخاطر محفظة استثمارية.

اليوم الثالث

قياس الأداء الاستثماري والمعايير المرجعية

- مبادئ قياس الأداء الاستثماري.
- العوائد الاستثمارية الإجمالية والصافية.
- العائد المرجح زمنيًا والعائد المرجح نقديًا.
- اختيار المعايير المرجعية ومبادئ بنائها.
- قياس الأداء المطلق والنسبي.
- تقييم الأداء المعدل حسب المخاطر.
- تحليل العوائد ومساهمات مكونات المحفظة.
- التحديات الشائعة في قياس الأداء الاستثماري.
- تطبيق عملي: احتساب أداء محفظة استثمارية وتقييمه مقارنة بالمعيار المرجعي.

اليوم الرابع

تحليل مساهمات الأداء وتقييم المحافظ

- مبادئ تحليل مساهمات الأداء.
- تحليل مساهمة تخصيص الأصول في الأداء.
- تحليل اختيار الاستثمارات والقرارات الاستثمارية.
- تحليل توقيت السوق ومراكز المحفظة.
- تحليل أداء محافظ أدوات الدخل الثابت.

اليوم الرابع — تابع

- تقييم أداء محافظ الأسهم والمحافظ متعددة الأصول.
- ربط أداء المحفظة بالأهداف الاستثمارية ومستويات المخاطر.
- تحديد مصادر الأداء وأسباب ضعف الأداء.
- تطبيق عملي: إجراء تحليل متكامل لمساهمات أداء محفظة استثمارية.

اليوم الخامس

التكامل بين إدارة المخاطر وقياس الأداء

- التكامل بين إدارة مخاطر الاستثمار وقياس الأداء.
- تطوير مؤشرات المخاطر والأداء الاستثماري.
- إعداد تقارير المحافظ للإدارة العليا ولجان الاستثمار.
- تقييم المحافظ وفق العائد المعدل حسب المخاطر ودعم القرارات الاستثمارية.
- اختبارات الضغط وتقييم الأداء وفق السيناريوهات.
- مراجعة الاستراتيجية الاستثمارية وتحسين أداء المحفظة.
- الحوكمة والمساءلة والرقابة على الاستثمارات.
- تطوير إطار متكامل لمتابعة المحافظ وإعداد التقارير.
- ورشة ختامية: إعداد إطار متكامل لإدارة مخاطر الاستثمار وقياس الأداء وخطة عملية للتنفيذ.

للتسجيل أو لطلب مزيد من المعلومات

صفحة الدورة:

<https://quest-training.com/courses/investment-risk-management-performance-measurement-training-course>الموقع الإلكتروني: <https://quest-training.com>البريد الإلكتروني: info@quest-training.com

الهاتف: +905016771440