

رقم الدورة 1031

إدارة مخاطر السوق

إدارة المخاطر
التمويل والاستثمار والخدمات المصرفية

طريقة التقديم

حضور

التواريخ

١١-٢٠ نوفمبر ٢٠٢٢

المدة

5 أيام

المكان

تونس، تونس



تفاصيل الموعد المجدول

تونس، تونس

المدينة

٦١-٠٢ نوفمبر ٢٠٢٢

التاريخ

حضور

طريقة التقديم

€ ٠٨,٣٧

رسوم الدورة

نظرة عامة على الدورة

تعد دورة إدارة مخاطر السوق من البرامج التدريبية المتقدمة التي تهدف إلى تزويد العاملين في البنوك والمؤسسات المالية بالمعارف والمهارات اللازمة لتحديد وقياس وتقييم ومراقبة وإدارة مخاطر السوق وفق أفضل الممارسات الدولية. ومع التقلبات المستمرة في أسعار الفائدة، وأسعار الصرف، وأسعار الأسهم، والسلع، والأدوات المالية، أصبحت إدارة مخاطر السوق من الركائز الأساسية لضمان الاستقرار المالي، وحماية رأس المال، وتعزيز قدرة المؤسسات على اتخاذ قرارات استثمارية وتمويلية أكثر كفاءة.

يركز البرنامج على تطوير فهم متكامل لمفاهيم إدارة مخاطر السوق وأطرها المؤسسية، بما يشمل حوكمة المخاطر، وشهية المخاطر، ومنهجيات قياس التعرض للمخاطر، وتحليل العوامل المؤثرة في الأسواق المالية. كما يتناول البرنامج الأدوات الكمية والنوعية المستخدمة في قياس المخاطر، مثل القيمة المعرضة للمخاطر، واختبارات الضغط، وتحليل السيناريوهات، وتحليل الحساسية، بما يساعد المؤسسات على تقييم تأثير تقلبات الأسواق على محافظها المالية واتخاذ الإجراءات المناسبة للحد من المخاطر.

كما يستعرض البرنامج إدارة المخاطر المرتبطة بأسعار الفائدة، وأسعار العملات الأجنبية، وأسعار الأسهم، وأسعار السلع، بالإضافة إلى إدارة مخاطر المحافظ الاستثمارية، ومخاطر التداول، ومخاطر السيولة المرتبطة بالأسواق، مع التركيز على دور إدارة مخاطر السوق في دعم الحوكمة المؤسسية، والامتثال للمتطلبات الرقابية، وتعزيز الأداء المالي والاستدامة المؤسسية.

ومن خلال التطبيقات العملية ودراسات الحالة الواقعية، سيتمكن المشاركون من تطوير قدراتهم في تحليل البيانات

المالية، وقياس التعرض لمخاطر السوق، وإعداد تقارير احترافية، وتصميم استراتيجيات فعالة للحد من المخاطر، بما يعزز جودة القرارات الاستثمارية، ويحسن إدارة المحافظ المالية، ويدعم المرونة المؤسسية في مواجهة تقلبات الأسواق.

أهداف الدورة

- تحليل مبادئ وأطر إدارة مخاطر السوق وتقييم تطبيقها في البنوك والمؤسسات المالية بنهاية البرنامج.
- تطوير منهجيات متكاملة لتحديد وقياس وتقييم ومراقبة مخاطر السوق في مختلف الأنشطة المالية.
- تقييم تأثير تقلبات أسعار الفائدة وأسعار الصرف والأسهم والسلع على المحافظ المالية.
- تطبيق أدوات قياس مخاطر السوق، بما في ذلك القيمة المعرضة للمخاطر، وتحليل الحساسية، وتحليل السيناريوهات، واختبارات الضغط.
- تصميم استراتيجيات فعالة للحد من مخاطر السوق وتحسين إدارة المحافظ الاستثمارية.
- تحسين عمليات مراقبة مخاطر السوق باستخدام مؤشرات الأداء ومؤشرات المخاطر الرئيسية.
- تعزيز حوكمة مخاطر السوق من خلال تطوير السياسات والضوابط الرقابية وآليات المتابعة.
- تنفيذ تقارير احترافية لمخاطر السوق تدعم الإدارة التنفيذية ولجان المخاطر.
- تقييم المخاطر الناشئة الناتجة عن التغيرات الاقتصادية والجيوسياسية والتطورات في الأسواق المالية.
- مواءمة ممارسات إدارة مخاطر السوق مع المتطلبات الرقابية والأهداف الاستراتيجية للمؤسسة قبل نهاية الدورة.

الفئة المستهدفة

تستهدف هذه الدورة مدراء إدارة مخاطر السوق، ومدراء إدارة المخاطر، ومدراء الخزينة، ومدراء الاستثمار، ومدراء المحافظ الاستثمارية، ومدراء التداول، ومدراء الأصول والخصوم، ومدراء الأسواق المالية، ومدراء الامتثال،

ومدراء التدقيق الداخلي، ومدراء الرقابة الداخلية، ومحلي المخاطر، ومحلي الاستثمار، والعاملين في إدارات الخزينة والاستثمار وإدارة المخاطر في البنوك والمؤسسات المالية.

كما تناسب الرؤساء التنفيذيين للمخاطر، والرؤساء التنفيذيين للاستثمار، ومدراء المالية، ومدراء التخطيط الاستراتيجي، وأعضاء لجان المخاطر، وأعضاء لجان الأصول والخصوم، والعاملين في المؤسسات الاستثمارية، وشركات إدارة الأصول، والبنوك المركزية، وجميع المهنيين المسؤولين عن تقييم وإدارة التعرض لمخاطر الأسواق المالية.

مخرجات التعلم

- بنهاية الدورة سيكون المشاركون قادرين على:
- بناء إطار متكامل لإدارة مخاطر السوق في المؤسسات المالية.
- تحديد وتحليل مصادر مخاطر السوق وتقييم تأثيرها على المحافظ المالية.
- تطبيق منهجيات قياس مخاطر السوق باستخدام الأدوات الكمية والنوعية.
- احتساب وتفسير القيمة المعرضة للمخاطر واستخدامها في دعم اتخاذ القرار.
- تنفيذ اختبارات الضغط وتحليل السيناريوهات وتحليل الحساسية لتقييم المخاطر.
- تصميم استراتيجيات فعالة للحد من مخاطر أسعار الفائدة والعملات والأسهم والسلع.
- مراقبة أداء المحافظ الاستثمارية باستخدام مؤشرات المخاطر الرئيسية.
- إعداد تقارير احترافية لمخاطر السوق تدعم الإدارة التنفيذية ولجان المخاطر.
- تقييم المخاطر الناشئة وتأثير المتغيرات الاقتصادية والمالية على المؤسسة.
- إعداد خطة عملية لتعزيز منظومة إدارة مخاطر السوق بما يدعم الاستقرار المالي والامتثال والمرونة المؤسسية.

محاوّر الدورة

المحتوى التدريبي:

اليوم الأول

أساسيات إدارة مخاطر السوق

- مفهوم وأهمية إدارة مخاطر السوق.
- أنواع مخاطر السوق ومصادرها.
- حوكمة مخاطر السوق والأطر التنظيمية.
- العلاقة بين إدارة مخاطر السوق وإدارة المخاطر المؤسسية.
- تطبيق عملي: تحديد وتحليل التعرض لمخاطر السوق في مؤسسة مالية.

اليوم الثاني

قياس وتحليل مخاطر السوق

- منهجيات قياس مخاطر السوق.
- القيمة المعرضة للمخاطر.
- تحليل الحساسية وتحليل السيناريوهات.
- اختبارات الضغط وتقييم تأثير تقلبات الأسواق.
- تطبيق عملي: احتساب وقياس مخاطر السوق لمحفظة مالية.

اليوم الثالث

إدارة مخاطر الأسواق المالية

- إدارة مخاطر أسعار الفائدة.
- إدارة مخاطر أسعار الصرف.

اليوم الثالث — تابع

- إدارة مخاطر الأسهم والسلع.
- إدارة مخاطر المحافظ الاستثمارية والتداول.
- تطبيق عملي: تصميم استراتيجيات للحد من مخاطر السوق.

اليوم الرابع

الرقابة وإعداد تقارير مخاطر السوق

- مؤشرات المخاطر الرئيسية ومؤشرات الأداء.
- إعداد تقارير مخاطر السوق للإدارة العليا.
- متابعة التعرض للمخاطر واتخاذ الإجراءات التصحيحية.
- المخاطر الناشئة في الأسواق المالية العالمية.
- تطبيق عملي: إعداد تقرير متكامل لمخاطر السوق وتحليل نتائجه.

اليوم الخامس

التميز في إدارة مخاطر السوق

- دمج إدارة مخاطر السوق مع إدارة المخاطر المؤسسية.
- تعزيز الحوكمة والرقابة والامتثال.
- أفضل الممارسات العالمية في إدارة مخاطر السوق.
- التحسين المستمر وإدارة الأداء في بيئة الأسواق المالية.
- الورشة الختامية: إعداد خطة تنفيذ متكاملة لتطوير منظومة إدارة مخاطر السوق داخل المؤسسة، تتضمن تطوير الحوكمة، ومنهجيات القياس، واختبارات الضغط، وتحليل السيناريوهات، ومؤشرات المخاطر الرئيسية، وآليات إعداد التقارير والمتابعة، بما يعزز جودة القرارات الاستثمارية، ويدعم الامتثال، ويحسن المرونة المؤسسية في مواجهة تقلبات الأسواق المالية.



للتسجيل أو لطلب مزيد من المعلومات

صفحة الدورة: <https://quest-training.com/courses/market-risk-management>

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

البريد الإلكتروني: info@quest-training.com

الهاتف: +905016771440

