

رقم الدورة 1052

أسواق النقد وأدوات الدخل الثابت

الخزينة والأسواق المالية
التمويل والاستثمار والخدمات المصرفية

طريقة التقديم

حضور

المدة

5 أيام



نظرة عامة على الدورة

تُعد دورة أسواق النقد وأدوات الدخل الثابت من البرامج التدريبية المتقدمة التي تهدف إلى تزويد العاملين في البنوك والمؤسسات المالية بالمعارف والمهارات اللازمة لفهم آليات عمل أسواق النقد، وإدارة الاستثمارات في أدوات الدخل الثابت، وتحليل تأثيرها على إدارة السيولة، وإدارة الخزينة، وإدارة المخاطر، وتحقيق أفضل عائد ممكن ضمن مستويات المخاطر المقبولة. وفي ظل التغيرات المستمرة في أسعار الفائدة والسياسات النقدية وتقلبات الأسواق المالية، أصبحت المعرفة المتخصصة بأسواق النقد وأدوات الدخل الثابت ضرورة استراتيجية لدعم القرارات الاستثمارية والمالية.

يركز البرنامج على بناء فهم متكامل لأسواق النقد، ومكوناتها، وأهم المشاركين فيها، والأدوات المالية قصيرة الأجل مثل أذونات الخزينة، وشهادات الإيداع، والأوراق التجارية، واتفاقيات إعادة الشراء (Repos)، إضافة إلى دراسة أدوات الدخل الثابت طويلة ومتوسطة الأجل، بما في ذلك السندات الحكومية، وسندات الشركات، والصكوك، والسندات ذات العائد المتغير، مع توضيح خصائص كل أداة، وآليات تسعيرها، واستخداماتها الاستثمارية والتمويلية. كما يستعرض البرنامج أساليب تقييم أدوات الدخل الثابت، وتحليل منحى العائد، وقياس المدة الزمنية (Duration)، والتحدب (Convexity)، وإدارة مخاطر أسعار الفائدة، ومخاطر الائتمان، ومخاطر السيولة، وإدارة المحافظ الاستثمارية، بالإضافة إلى دور أسواق النقد في إدارة السيولة والتمويل، ودعم إدارة الأصول والخصوم، وإدارة الخزينة، مع التركيز على المتطلبات التنظيمية وأفضل الممارسات العالمية.

ومن خلال التطبيقات العملية ودراسات الحالة الواقعية، سيتمكن المشاركون من تقييم فرص الاستثمار في أدوات الدخل الثابت، وتحليل أوضاع أسواق النقد، وإدارة المحافظ الاستثمارية، وقياس المخاطر، وإعداد التقارير التنفيذية، وتعزيز التكامل بين أنشطة الاستثمار، والخزينة، وإدارة المخاطر، والإدارة المالية، بما يدعم تحقيق الاستقرار المالي وتعظيم القيمة المؤسسية.

أهداف الدورة

- تحليل مبادئ أسواق النقد وأدوات الدخل الثابت وتقييم تطبيقها في المؤسسات المالية بنهاية البرنامج.

- تطوير فهم شامل لهيكل أسواق النقد، وأدوات التمويل والاستثمار قصيرة وطويلة الأجل.
- تقييم أدوات الدخل الثابت باستخدام أساليب التسعير والتحليل المالي الحديثة.
- تطبيق منهجيات تحليل منحني العائد، والمدة الزمنية (Duration)، والتحدب (Convexity) في إدارة المحافظ.
- تصميم استراتيجيات استثمار فعالة تدعم إدارة السيولة وتحقيق التوازن بين العائد والمخاطر.
- تحسين إدارة مخاطر أسعار الفائدة، ومخاطر الائتمان، ومخاطر السيولة المرتبطة بأدوات الدخل الثابت.
- تعزيز الحوكمة من خلال تطوير سياسات الاستثمار، والرقابة الداخلية، وإدارة المحافظ.
- تنفيذ مؤشرات الأداء ومؤشرات المخاطر الرئيسية لتقييم أداء المحافظ الاستثمارية.
- تقييم التحديات الناشئة المرتبطة بالتغيرات الاقتصادية، والسياسات النقدية، والتحول الرقمي، والتكنولوجيا المالية.
- موازنة إدارة أسواق النقد وأدوات الدخل الثابت مع إدارة الخزينة، وإدارة الأصول والخصوم، وإدارة المخاطر المؤسسية قبل نهاية الدورة.

الفئة المستهدفة

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

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

مخرجات التعلم

- بنهاية الدورة سيكون المشاركون قادرين على:
- بناء إطار متكامل لإدارة الاستثمارات في أسواق النقد وأدوات الدخل الثابت.
- تقييم أدوات الدخل الثابت واختيار الأدوات المناسبة وفق الأهداف الاستثمارية.
- تطبيق أساليب تسعير السندات وتحليل منحى العائد والمدة الزمنية والتحدب.
- تصميم محافظ استثمارية متنوعة تحقق التوازن بين العائد والمخاطر.
- إدارة مخاطر أسعار الفائدة، ومخاطر الائتمان، ومخاطر السيولة المرتبطة بالاستثمارات.
- تطوير استراتيجيات استثمار تدعم إدارة السيولة والخزينة وإدارة الأصول والخصوم.
- إعداد تقارير احترافية للإدارة العليا حول أداء المحافظ الاستثمارية ومؤشرات الأداء.
- تطوير مؤشرات الأداء ومؤشرات المخاطر الرئيسية لمتابعة كفاءة الاستثمارات.
- تقييم أثر السياسات النقدية والتطورات الاقتصادية على قرارات الاستثمار.
- إعداد خطة تنفيذية لتطوير إدارة أسواق النقد وأدوات الدخل الثابت بما يعزز الأداء المالي والاستدامة المؤسسية.

محاوور الدورة

المحتوى التدريبي:

اليوم الأول

أساسيات أسواق النقد وأدوات الدخل الثابت

- مفهوم وأهمية أسواق النقد.
- المشاركون في أسواق النقد.

اليوم الأول — تابع

- أدوات التمويل قصيرة الأجل.
- مقدمة في أدوات الدخل الثابت.
- تطبيق عملي: تحليل أوضاع أسواق النقد وفرص الاستثمار.

اليوم الثاني

تقييم أدوات الدخل الثابت

- تسعير السندات والصكوك.
- تحليل منحى العائد.
- المدة الزمنية (Duration).
- التحدب (Convexity).
- تطبيق عملي: تقييم أدوات دخل ثابت وبناء محفظة استثمارية.

اليوم الثالث

إدارة المحافظ والمخاطر

- إدارة المحافظ الاستثمارية.
- إدارة مخاطر أسعار الفائدة.
- إدارة مخاطر الائتمان والسيولة.
- استراتيجيات الاستثمار المؤسسي.
- تطبيق عملي: تحليل مخاطر محفظة أدوات دخل ثابت.

اليوم الرابع

الحوكمة والرقابة وإعداد التقارير

- حوكمة الاستثمار وإدارة المحافظ.
- مؤشرات الأداء ومؤشرات المخاطر الرئيسية.
- التقارير التنفيذية والرقابية.
- اختبارات الضغط وتحليل السيناريوهات.
- تطبيق عملي: إعداد لوحة مؤشرات أداء للمحفظة الاستثمارية.

اليوم الخامس

التميز في إدارة أسواق النقد وأدوات الدخل الثابت

- أفضل الممارسات العالمية في إدارة المحافظ الاستثمارية.
- التكامل بين إدارة الخزينة، وإدارة الأصول والخصوم، وإدارة المخاطر.
- التحول الرقمي والتكنولوجيا المالية في الأسواق المالية.
- التحسين المستمر ورفع كفاءة الأداء الاستثماري.
- الورشة الختامية: إعداد خطة تنفيذ متكاملة لتطوير إدارة أسواق النقد وأدوات الدخل الثابت، تشمل تحليل الأسواق، وتقييم أدوات الاستثمار، وبناء المحافظ، وإدارة مخاطر أسعار الفائدة والائتمان والسيولة، وتحليل منحنى العائد، وإجراء اختبارات الضغط، وتعزيز الحوكمة والرقابة، وإعداد التقارير التنفيذية، وآليات المتابعة والتحسين المستمر، بما يدعم الاستقرار المالي، ويعزز كفاءة الاستثمار، ويرفع جودة إدارة المحافظ، ويحقق النمو والاستدامة المؤسسية.



للتسجيل أو لطلب مزيد من المعلومات

صفحة الدورة: <https://quest-training.com/courses/money-markets-fixed-income-instruments>

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

البريد الإلكتروني: info@quest-training.com

الهاتف: +905016771440

