

رقم الدورة 1054

# إدارة مخاطر الخزينة

الخزينة والأسواق المالية  
التمويل والاستثمار والخدمات المصرفية

طريقة التقديم

حضور

التواريخ

٩١-٣٢ أكتوبر ٢٠٢٢

المدة

5 أيام

المكان

لشبونة، البرتغال



## تفاصيل الموعد المجدول

لشبونة، البرتغال

المدينة

٩١-٣٢ أكتوبر ٢٠٢٢

التاريخ

حضور

طريقة التقديم

€ ٠٠٤,٥٠

رسوم الدورة

## نظرة عامة على الدورة

تعد دورة إدارة مخاطر الخزينة من البرامج التدريبية المتقدمة التي تهدف إلى تزويد العاملين في البنوك والمؤسسات المالية بالمعارف والمهارات اللازمة لتحديد وقياس ومراقبة وإدارة المخاطر المرتبطة بأنشطة الخزينة وفق أفضل الممارسات المصرفية والمعايير الدولية. وتؤدي إدارة الخزينة دوراً محورياً في المحافظة على السيولة، وإدارة التمويل، والاستثمار، والتعامل في الأسواق المالية، الأمر الذي يجعل الإدارة الفعالة لمخاطر الخزينة عاملاً أساسياً في تعزيز الاستقرار المالي وتحقيق الأهداف الاستراتيجية للمؤسسة.

يركز البرنامج على بناء فهم متكامل لمختلف أنواع مخاطر الخزينة، بما في ذلك مخاطر السيولة، ومخاطر السوق، ومخاطر أسعار الفائدة، ومخاطر أسعار الصرف، ومخاطر التمويل، ومخاطر الطرف المقابل، ومخاطر التسوية، والمخاطر التشغيلية، مع توضيح كيفية قياس هذه المخاطر وتحليلها باستخدام الأساليب والأدوات الحديثة، بما يضمن اتخاذ قرارات مالية مدروسة وتحقيق التوازن بين العائد والمخاطر.

كما يستعرض البرنامج أطر الحوكمة والرقابة الخاصة بإدارة مخاطر الخزينة، ودور لجنة إدارة الأصول والخصوم، واهوي رانيسل ليلحتو، طغضلا تارابتخاو، رطاخمل دودج قراداو، تاءارجل او تاسايسل او (OCLA)، وخطط التمويل في حالات الطوارئ، إضافة إلى متطلبات لجنة بازل والجهات الرقابية، ومؤشرات الأداء، ومؤشرات المخاطر الرئيسية، بما يعزز الامتثال والمرونة المؤسسية.

ومن خلال التطبيقات العملية ودراسات الحالة الواقعية، سيتمكن المشاركون من تقييم التعرض لمخاطر الخزينة، وتصميم استراتيجيات فعالة لإدارة المخاطر، وتحسين إدارة السيولة والتمويل، وإعداد التقارير التنفيذية، وتعزيز

التكامل بين إدارة الخزينة، وإدارة الأصول والخصوم، وإدارة المخاطر المؤسسية، والإدارة المالية، بما يدعم الأداء المالي والاستدامة المؤسسية.

## أهداف الدورة

- تحليل مبادئ إدارة مخاطر الخزينة وتقييم تطبيقها في المؤسسات المالية بنهاية البرنامج.
- تطوير إطار متكامل لإدارة مخاطر الخزينة يتوافق مع أفضل الممارسات الدولية والمتطلبات الرقابية.
- تقييم التعرض لمخاطر السيولة، ومخاطر السوق، ومخاطر أسعار الفائدة، ومخاطر أسعار الصرف، ومخاطر التمويل، ومخاطر الطرف المقابل.
- تطبيق أدوات قياس المخاطر، وتحليل الحساسية، والقيمة المعرضة للمخاطر (VaR)، واختبارات الضغط، وتحليل السيناريوهات.
- تصميم استراتيجيات فعالة للحد من مخاطر الخزينة باستخدام أدوات التحوط وتحسين إدارة الميزانية العمومية.
- تحسين عمليات إدارة السيولة والتمويل بما يعزز الاستقرار المالي والمرونة المؤسسية.
- تعزيز الحوكمة والرقابة من خلال تطوير السياسات والإجراءات ودور لجنة إدارة الأصول والخصوم (ALCO).
- تنفيذ مؤشرات الأداء ومؤشرات المخاطر الرئيسية لمراقبة فعالية إدارة مخاطر الخزينة.
- تقييم التحديات الناشئة المرتبطة بالتحول الرقمي، والتكنولوجيا المالية، والتقلبات الاقتصادية، والتغيرات التنظيمية.
- مواصلة إدارة مخاطر الخزينة مع إدارة الأصول والخصوم، وإدارة المخاطر المؤسسية، وإدارة السيولة، والإدارة المالية قبل نهاية الدورة.

كما تناسب الرؤساء التنفيذيين للشؤون المالية، والرؤساء التنفيذيين للمخاطر، وأعضاء لجنة إدارة الأصول والخصوم قي زكرملا كون بل ايف نيل ماعلاو، قي ذي فنتلا قرا دل اإل اضعأو، رطاخملا ن ا جل اضعأو، (OCLA) والجهات الرقابية، وشركات الاستثمار، وشركات إدارة الأصول، وشركات التأمين، والمؤسسات المالية، وجميع المهنيين المسؤولين عن إدارة الخزينة، وإدارة الميزانية العمومية، وإدارة المخاطر، والتخطيط المالي، والحوكمة المؤسسية.

- بنهاية الدورة سيكون المشاركون قادرين على:
- بناء إطار متكامل لإدارة مخاطر الخزينة وفق أفضل الممارسات المصرفية.
- تقييم وقياس مختلف أنواع المخاطر المرتبطة بأنشطة الخزينة.
- تطبيق أدوات القيمة المعرضة للمخاطر (VaR)، وتحليل الحساسية، واختبارات الضغط، وتحليل السيناريوهات.
- تصميم استراتيجيات فعالة للتحوط من مخاطر السوق، والسيولة، وأسعار الفائدة، وأسعار الصرف.
- تطوير خطط التمويل في حالات الطوارئ وتعزيز مرونة المؤسسة المالية.
- إعداد تقارير احترافية للإدارة العليا حول التعرض للمخاطر ومؤشرات الأداء.
- تطوير سياسات وضوابط داخلية تعزز الحوكمة والرقابة على أنشطة الخزينة.
- دمج إدارة مخاطر الخزينة مع إدارة الأصول والخصوم، وإدارة المخاطر المؤسسية، وإدارة السيولة.

- تقييم أثر التكنولوجيا المالية والتحول الرقمي على مخاطر الخزينة.
- إعداد خطة تنفيذية لتعزيز إدارة مخاطر الخزينة بما يدعم الاستقرار المالي والامتثال للمتطلبات التنظيمية.

## محاوّر الدورة

المحتوى التدريبي:

### اليوم الأول

## أساسيات إدارة مخاطر الخزينة

- مفهوم وأهداف إدارة مخاطر الخزينة.
- وظائف إدارة الخزينة وهيكلها التنظيمي.
- أنواع مخاطر الخزينة.
- المتطلبات التنظيمية وأفضل الممارسات الدولية.
- تطبيق عملي: تقييم التعرض لمخاطر الخزينة في مؤسسة مصرفية.

### اليوم الثاني

## قياس وتحليل مخاطر الخزينة

- قياس مخاطر السيولة.
- قياس مخاطر السوق وأسعار الفائدة.
- قياس مخاطر أسعار الصرف.
- القيمة المعرضة للمخاطر (VaR) وتحليل الحساسية.
- تطبيق عملي: تحليل المخاطر باستخدام أدوات القياس الحديثة.

## اليوم الثالث

## استراتيجيات إدارة مخاطر الخزينة

- استراتيجيات التحوط وإدارة التعرض للمخاطر.
- اختبارات الضغط وتحليل السيناريوهات.
- خطط التمويل في حالات الطوارئ.
- تحسين هيكل الميزانية العمومية.
- تطبيق عملي: إعداد استراتيجية متكاملة لإدارة مخاطر الخزينة.

## اليوم الرابع

## الحوكمة والرقابة وإعداد التقارير

- دور لجنة إدارة الأصول والخصوم (ALCO).
- الحوكمة والضوابط الداخلية.
- مؤشرات الأداء ومؤشرات المخاطر الرئيسية.
- التقارير التنفيذية والرقابية.
- تطبيق عملي: إعداد لوحة مؤشرات وتقارير لإدارة مخاطر الخزينة.

## اليوم الخامس

## التميز في إدارة مخاطر الخزينة

- أفضل الممارسات العالمية في إدارة مخاطر الخزينة.
- التكامل مع إدارة الأصول والخصوم، وإدارة المخاطر المؤسسية، والإدارة المالية.
- التحول الرقمي والتقنيات الحديثة في إدارة مخاطر الخزينة.
- التحسين المستمر وتعزيز مرونة إدارة الخزينة.

اليوم الخامس — تابع

- الورشة الختامية: إعداد خطة تنفيذ متكاملة لتطوير منظومة إدارة مخاطر الخزينة، تشمل تحديد وقياس المخاطر، وإدارة السيولة والتمويل، وإدارة مخاطر السوق وأسعار الفائدة وأسعار الصرف، وتطبيق اختبارات الضغط، وتعزيز الحوكمة والرقابة، وإعداد التقارير التنفيذية، وآليات المتابعة والتحسين المستمر، بما يدعم الاستقرار المالي، ويعزز الامتثال للمتطلبات التنظيمية، ويرفع كفاءة إدارة الخزينة، ويحقق الاستدامة المؤسسية.

## للتسجيل أو لطلب مزيد من المعلومات

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

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

البريد الإلكتروني: [info@quest-training.com](mailto:info@quest-training.com)

الهاتف: +905016771440