

إدارة المحافظ والأصول

المتقدمة DECNAVDA

TESSA DNA OILOFTROP

TNEMEGANAM



GENTEX®
TRAINING CENTER



المقدمة

تمنح دورة إدارة المحافظ والأصول المتقدمة التدريبية المتخصصين الماليين استراتيجيات عملية لبناء المحافظ الاستثمارية وإدارتها وتقييمها في الأسواق المتغيرة. يستكشف المشاركون توزيع الأصول وتقييم المخاطر وقياس الأداء من خلال أطر عمل معتمدة تستخدمها كبرى شركات الاستثمار. تجمع الدورة بين الجانب النظري والتقنيات العملية، وتغطي الأسهم والسندات والاستثمارات البديلة والمشتقات المالية. علاوة على ذلك، تتناول الدورة مبادئ التمويل السلوكي التي تؤثر في قرارات المستثمرين ونتائج الأسواق. يكتسب المشاركون الثقة اللازمة لتصميم محافظ متنوعة توازن بين المخاطر والعوائد بموضوعية. ونتيجة لذلك، يخرج المشاركون بأدوات تدعم اتخاذ قرارات استثمارية أكثر ذكاءً، وتعزز العلاقات مع العملاء، وتوائم استراتيجيات المحافظ مع أهداف المؤسسة ومتطلباتها التنظيمية.

أهداف دورة إدارة المحافظ والأصول المتقدمة

- تطبيق نظرية المحفظة الحديثة TPM لبناء محافظ استثمارية متنوعة
- استخدام نموذج تسعير الأصول الرأسمالية MPAC لتقييم العوائد والمخاطر المتوقعة
- حساب وتفسير نسبة شارب ونسبة ترينور وألفا جنسن لتقييم الأداء
- بناء نماذج توزيع أصول استراتيجية وتكتيكية عبر الأسهم والسندات والاستثمارات البديلة
- قياس مخاطر المحفظة باستخدام القيمة المعرضة للخطر RaV والانحراف المعياري
- تطبيق مفهوم الحد الأمثل الفعال ونموذج بلاك-ليترمان لتحسين مزيج الأصول
- دمج معايير الاستدامة GSE والاستثمارات البديلة، بما في ذلك الأسهم الخاصة وصناديق التحوط
- استخدام المشتقات المالية مثل الخيارات والعقود الآجلة للتحوط من مخاطر المحفظة



- تحليل مدة السندات وتحديثها لإدارة التعرض لمخاطر أسعار الفائدة
- تطبيق معايير الأداء الاستثماري العالمية SPIG لإعداد تقارير أداء دقيقة

منهجية الدورة

- محاضرات تفاعلية لشرح مفاهيم إدارة المحافظ الأساسية
- دراسات حالة لتحليل سيناريوهات السوق الفعلية وقرارات المحافظ
- تمارين جماعية لتطبيق نماذج توزيع الأصول والمخاطر
- ورش عمل عملية لحساب MPAC و RaV ونسبة شارب باستخدام جداول البيانات
- نقاشات حول اتجاهات السوق الحالية والتمويل السلوكي
- اختبارات تقييمية لترسيخ المفاهيم الأساسية

الفئات المستهدفة

- مديرو المحافظ والمحللون الماليون
- مستشارو إدارة الثروات والمصرفيون الخاصون
- المتخصصون في المالية والخزينة
- مسؤولو إدارة المخاطر
- تنفيذيو إدارة الأصول
- المخططون الماليون الراغبون في تطوير معرفتهم الاستثمارية
- فرق التمويل المؤسسي المشرفة على القرارات الاستثمارية



محتوى دورة إدارة المحافظ والأصول المتقدمة

اليوم الأول: أسس إدارة المحافظ

- نظرة عامة على أهداف الاستثمار وقيوده
- مقدمة في نظرية المحفظة الحديثة TPM
- أساسيات المخاطر والعوائد
- مبادئ التنويع وتحليل الارتباط
- مفهوم الحد الأمثل الفعال
- نظرة عامة على فئات الأصول: الأسهم والسندات والبدايل
- إعداد بيانات السياسة الاستثمارية

اليوم الثاني: استراتيجيات توزيع الأصول

- توزيع الأصول الاستراتيجي مقابل التكتيكي
- تطبيق نموذج تسعير الأصول الرأسمالية MPAC
- نموذج بلاك-ليترمان لتحسين المحفظة
- تقنيات إعادة التوازن ومحفزاتها
- بناء محافظ متعددة الأصول
- دمج معايير الاستدامة في توزيع الأصول



- الاستثمارات البديلة: الأسهم الخاصة وصناديق التحوط والعقارات

اليوم الثالث: إدارة مخاطر المحفظة

- طرق حساب القيمة المعرضة للخطر RaV

- تحليل الانحراف المعياري والتقلب

- اختبار الإجهاد وتحليل السيناريوهات

- محاكاة مونت كارلو لتقييم المخاطر

- مخاطر أسعار الفائدة: المدة والتحدب

- تقييم مخاطر الائتمان في السندات

- استخدام المشتقات المالية للتحوط

اليوم الرابع: قياس الأداء وتقييمه

- نسبة شارب ونسبة ترينور وألفا جنسن

- تحليل إسناد الأداء

- قياس أداء المحفظة مقارنة بالمؤشرات

- معايير الأداء الاستثماري العالمية SPIG

- مقاييس العائد المعدل حسب المخاطر

- تقييم أداء مديري الصناديق

- تقنيات إعداد التقارير للعملاء وأصحاب المصلحة



اليوم الخامس: التمويل السلوكي والتطبيقات المتقدمة

- التحيزات السلوكية المؤثرة في القرارات الاستثمارية
- الشذوذ السوقي وتأثيره في المحافظ
- دمج التكنولوجيا والتحليلات في إدارة المحافظ
- الاعتبارات التنظيمية في إدارة الأصول
- بناء خطة استثمارية شاملة
- دراسة حالة: بناء محفظة متنوعة
- مراجعة الدورة وأهم النقاط المستفادة

الخاتمة

بإتمام دورة إدارة المحافظ والأصول المتقدمة التدريبية بنجاح، يكتسب المشاركون مهارات عملية في توزيع الأصول وتقييم المخاطر وقياس الأداء. كما يفهمون كيفية تطبيق نظرية المحفظة الحديثة ونموذج MPAC وتقنيات القيمة المعرضة للخطر لبناء محافظ متينة ومتنوعة. إضافة إلى ذلك، يكتسب المشاركون رؤى حول التمويل السلوكي والاستثمارات البديلة التي تشكل الأسواق الحديثة. يزود مركز جينتكس للتدريب المشاركين بالمعرفة اللازمة لاتخاذ قرارات استثمارية استراتيجية ومدرسة، ودعم أهداف النمو المالي لمؤسساتهم.



الأسئلة الشائعة

السؤال الأول: ما هي دورة "إدارة المحافظ والأصول المتقدمة"؟

تتناول هذه الدورة المبادئ والتقنيات المستخدمة لبناء المحافظ الاستثمارية وإدارتها وتقييمها. وتستكشف توزيع الأصول وإدارة المخاطر وقياس الأداء، مما يمنح المشاركين المهارات اللازمة لبناء محافظ متنوعة تتماشى مع أهداف استثمارية محددة وظروف السوق.

السؤال الثاني: ما هي أبرز فوائد الالتحاق بدورة "إدارة المحافظ والأصول المتقدمة"؟

يكتسب المشاركون أدوات عملية لتحسين توزيع الأصول، وإدارة المخاطر بفعالية، وقياس أداء المحفظة بدقة. كما تعزز الدورة قدرات اتخاذ القرار، مما يساعد المتخصصين على تصميم محافظ توازن بين المخاطر والعوائد وتلبي أهداف العملاء والمؤسسات.



السؤال الثالث: ما هي المهارات التي سأكتسبها من دورة "إدارة المحافظ والأصول المتقدمة"؟

يطور المشاركون مهارات في بناء المحافظ وتقييم المخاطر وقياس الأداء واستراتيجية توزيع الأصول. تمكن هذه الكفاءات الأساسية المتخصصين من تحليل بيانات السوق وتطبيق نماذج استثمارية معتمدة واتخاذ قرارات سليمة في بيئات مالية معقدة.

السؤال الرابع: ما هي الأدوات أو المنهجيات أو المعايير التي تغطيها دورة "إدارة المحافظ والأصول المتقدمة"؟

تغطي الدورة نظرية المحفظة الحديثة، ونموذج تسعير الأصول الرأسمالية، والقيمة المعرضة للخطر، ونموذج بلاك-ليترمان، ومعايير الأداء الاستثماري العالمية SPIG. كما يتعلم المشاركون استخدام المشتقات المالية ومحاكاة مونت كارلو لإدارة المخاطر والتنبؤ.



السؤال الخامس: كيف يتم تطبيق ما تتضمنه دورة "إدارة المحافظ والأصول المتقدمة" في بيئة العمل الفعلية؟

يطبق المشاركون نظريات المحافظ على بيانات السوق الفعلية، ويبينون محافظ متنوعة ويختبرونها مقابل سيناريوهات المخاطر. تنتقل هذه المهارات مباشرة إلى التحليل الاستثماري اليومي، وأعمال الاستشارات للعملاء، وقرارات إدارة الأصول الاستراتيجية داخل المؤسسات العالية.