



دورة إدارة مخاطر الاستثمار لمديري الأصول



AGILE LEADERS
Training Center



دورة إدارة مخاطر الاستثمار لمديري الأصول

نظرة عامة

دورة إدارة مخاطر الاستثمار لمديري الأصول هي دورة لمدة أسبوع لمديري الأصول والمحافظ ومتخصصي مخاطر الاستثمار وفرق حوكمة الصناديق ومالكي الضوابط، ويخرج المشاركون بحزمة حوكمة مخاطر المحفظة. يطبق المشاركون إدارة مخاطر الاستثمار من خلال تصنيف مخاطر المحفظة واختبارات ضغط السيولة ومراقبة حدود المخاطر ومراجعة الأداء المعدل حسب المخاطر. تربط الدورة قيود التفويض بقياس التعرضات والتعصيد وقرارات اللجنة. تقدم أجابيل للتدريب حوكمة مخاطر الاستثمار كمسار منضبط لقرار المحفظة.

الفئة المستهدفة

- الوظائف المسؤولة عن تخصيص الأصول وقرارات المحافظ
- الفرق المسؤولة عن قياس مخاطر الاستثمار والإشراف عليها
- الوظائف المسؤولة عن حوكمة الصناديق وضوابط التفويض
- الفرق المسؤولة عن ضوابط التداول وتعصيد التجاوزات
- الوظائف المسؤولة عن تقارير لجنة الاستثمار

تفترض الدورة أن المشاركين يعملون مع المحافظ أو ضوابط الاستثمار أو تقارير المخاطر، ولا تتناول مبادئ الاستثمار الأولية أو مشورة اختيار الأوراق المالية أو التفسير القانوني.

الإدارات والقطاعات المستهدفة

تدعم الدورة الإدارات والقطاعات التي تدير الأصول المستثمرة أو التفويضات المسندة أو الإشراف على المحافظ.

- إدارة الأصول والاستثمار وإدارة المحافظ
- مخاطر الاستثمار والامتثال والحوكمة
- مؤسسات التقاعد والتأمين وإدارة الثروات
- الخدمات المصرفية والخزينة والاستثمار المؤسسي
- الأوقاف والمكاتب العائلية والاستشارات الاستثمارية



أهداف التعلم

بنهاية هذه الدورة، سيكون المشاركون قادرين على:

- بناء تصنيف لمخاطر المحفظة مرتبط بالتفويض
- تحليل تعرضات السوق والائتمان والطرف المقابل والتركيز
- تطبيق اختبارات ضغط السيولة على قرارات الاسترداد
- تقييم مخاطر التقييم والنماذج والتشغيل والتعهد
- استخدام مراقبة حدود المخاطر وضوابط تصعيد التجاوزات
- مقارنة الأداء المعدل حسب المخاطر ونتائج تحليل الإسناد

جدول الدورة

اليوم 1: تفويض الاستثمار وهيكل المخاطر

- خريطة مخاطر تفويض الاستثمار
- تصنيف مخاطر المحفظة
- جدول شهية المخاطر وحدودها
- مصفوفة مسؤوليات حوكمة الاستثمار
- قائمة ربط سياسة المخاطر بالضوابط

اليوم 2: مخاطر السوق والائتمان والتركيز

- خريطة تعرض المحفظة لعوامل المخاطر
- ورقة مقارنة القيمة المعرضة للمخاطر والعجز المتوقع
- شبكة حساسية أسعار الفائدة وهوامش الائتمان
- بطاقة تقييم مخاطر ائتمان الطرف المقابل
- لوحة تعرضات المخاطر والتركيز



اليوم 3: مخاطر السيولة والنماذج والتشغيل

- تصنيف السيولة وملف الاسترداد
- اختبار ضغط سيولة المحفظة
- سجل مخاطر التقييم والنماذج
- تقييم مخاطر التعهيد والأطراف الخارجية
- سجل إخفاقات ضوابط التداول والتشغيل

اليوم 4: المراقبة وقرارات المخاطر

- مصفوفة ضوابط ما قبل التداول وما بعده
- سجل تجاوز حدود المخاطر وتصعيدها
- تحليل السيناريو واختبار الضغط العكسي
- مراجعة الأداء المعدل حسب المخاطر وتحليل الإسناد
- حزمة تقارير مخاطر لجنة الاستثمار

اليوم 5: ممارسة مخاطر مدير الأصول

- تمرين: مواءمة التفويض وشهية المخاطر
- تمرين: مراجعة التعرض والتركيز
- تمرين: ضغط السيولة وقرار الاسترداد
- تمرين: تجاوز الحدود والتصعيد إلى اللجنة
- المشروع الختامي: حزمة حوكمة مخاطر المحفظة

التمارين التطبيقية

تستخدم الدورة أنشطة مقترحة تربط قيود التفويض ببيانات التعرض ونتائج الضغط والحدود وقرارات الحوكمة.

- نشاط مقترح: ربط تفويض محفظة تقاعد بشهية المخاطر والحدود وملكية الضوابط.
- نشاط مقترح: تقييم تعرضات العوامل والائتمان والطرف المقابل والتركيز لمحفظة تأمين.
- نشاط مقترح: اختبار سيناريو استرداد صندوق مقابل فئات السيولة ومحفزات التصعيد.
- نشاط مقترح: إعداد قرار تجاوز وتقرير مخاطر للجنة بشأن محفظة ثروات.



الأسئلة الشائعة

لمن تناسب دورة إدارة مخاطر الاستثمار لمديري الأصول؟

تناسب دورة إدارة مخاطر الاستثمار من يتخذون قرارات المحافظ أو يقيسون التعرضات أو يملكون ضوابط التفويض أو يراقبون الحدود أو يقدمون التقارير للجان الاستثمار، وتفترض خبرة عملية بالمحافظ أو ضوابط المخاطر أو تقارير الاستثمار.

كيف تختلف إدارة مخاطر الاستثمار عن إدارة مخاطر المؤسسة؟

تربط إدارة مخاطر الاستثمار تفويضات المحافظ والتعرضات للعوامل والسيولة والأطراف المقابلة ونماذج التقييم والحدود والنتائج المعدلة حسب المخاطر، بينما تنسق إدارة مخاطر المؤسسة المخاطر الاستراتيجية والتشغيلية الأوسع.

كيف تراقب حدود مخاطر المحافظ وتصعد تجاوزاتها؟

تراقب حدود مخاطر المحافظ عبر فحوص ما قبل التداول وقياسات ما بعده والحدود وسجلات الاستثناء وتحديد الملكية ومعايير التصعيد والقرارات الموثقة وأدلة المتابعة.

كيف تدعم اختبارات ضغط السيولة مديري الأصول؟

تقارن اختبارات ضغط السيولة فئات سيولة الأصول وملفات الاسترداد وظروف السوق وقيود المعاملات والاستجابات المتاحة لكشف العجز وحوكمة القرار قبل تصاعد الضغط.

كيف يستخدم الأداء المعدل حسب المخاطر في الإشراف على المحافظ؟

يقارن الأداء المعدل حسب المخاطر العوائد بالمخاطر المحتملة ويربط نتائج تحليل الإسناد بالتعرضات والحدود وأهداف التفويض ونتائج السيناريو لدعم تحدي المحفظة وقرارات اللجنة.

الخاتمة

تدمج الدورة تفسير التفويض وقياس التعرض وتحليل السيولة ومراقبة الضوابط والتصعيد وتقرير اللجان. يأخذ المشاركون حزمة حوكمة مخاطر المحفظة التي تضم الخرائط والجداول واللوحات واختبارات الضغط والسجلات وقرارات الحوكمة. تنشئ الحزمة مساراً متكرراً من تفويض المحفظة إلى تعرض مقاس واستثناء محكوم وقرار استثماري موثق.



فئات الدورات التدريبية

الدورات التدريبية في مجال البيئة والاستدامة	الأعمال الزراعية والأمن الغذائي
دورات إدارة الجودة وتطوير العمليات	دورات إدارة الأزمات واستمرارية الأعمال
دورات إدارة المرافق والعقارات	دورات إدارة الرعاية الصحية
دورات إدارة و تحليل البيانات ودورات علم البيانات	دورات إدارة المنظمات غير الحكومية والعمل الإنساني والتنمية
دورات إدارة وعمليات الطيران	دورات إدارة و تطوير الموارد البشرية
دورات الاتصال الجماهيري و السياسات والعلاقات العامة	دورات الأمن السيبراني ودورات تقنية المعلومات
دورات التسويق وإدارة علاقات العملاء وإدارة المبيعات	دورات التدريب القانوني والمشتريات والتعاقدات
دورات الحكومة الرقمية والخدمات العامة	دورات التعليم وتطوير التعلم
دورات السكرتارية و إدارة المكاتب	دورات الحوكمة وإدارة المخاطر والامتثال
دورات الصحة والسلامة والأمن المهني	دورات الشحن والملاحة البحرية والموانئ
دورات الضيافة والسياحة	دورات الصيانة ودورات المجالات الهندسية المتنوعة
دورات المهارات الشخصية وتطوير الذات	دورات المحاسبة و التمويل و دورات الإدارة المالية
دورات في مجالات القيادة والإدارة	دورات حفظ التراث وإدارة المتاحف



فئات الدورات التدريبية

دورات معتمدة من قبل هيئات دولية

دورات قطاع النفط والغاز ودورات تقنية متنوعة

دورات مكتب إدارة المشاريع وإدارة المشاريع الرشيقة



مدن التدريب

أكرا غانا	أثينا اليونان	أبوظبي الإمارات العربية المتحدة
الدار البيضاء المغرب	استنبول تركيا	أمستردام هولندا
الكويت الكويت	القاهرة مصر	الدوحة قطر
باكو أذربيجان	باريس فرنسا	المنامة مملكة البحرين
براغ جمهورية التشيك	بانكوك تايلند	بالي جمهورية إندونيسيا
بورت لويس موريشيوس	برلين ألمانيا	برشلونة إسبانيا
تبليسي جورجيا	بوكيت تايلند	بورتو البرتغال
جنيف سويسرا	جاكرتا جمهورية إندونيسيا	تورنتو كندا
روما إيطاليا	دبي الإمارات العربية المتحدة	جوهانسبرغ جنوب إفريقيا
سان دييغو الولايات المتحدة الأمريكية	زيورخ سويسرا	زنبار تنزانيا
شم الشيخ مصر	سيول كوريا الجنوبية	سنغافورة سنغافورة
طشقند أوزبكستان	طرابزون تركيا	شيكاغو الولايات المتحدة الأمريكية



مدن التدريب

عن بعد منصة زووم	عمان المملكة الأردنية الهاشمية	طوكيو اليابان
كوالالمبور ماليزيا	فيينا النمسا	فرانكفورت ألمانيا
لانكاوي ماليزيا	لاغوس نيجيريا	كيب تاون جنوب إفريقيا
ماربيا اسبانيا	لندن المملكة المتحدة	لشبونة البرتغال
مونترال سويسرا	مسقط سلطنة عمان	مدريد إسبانيا
نيروبي كينيا	ميونخ ألمانيا	ميلان إيطاليا
	نيويورك الولايات المتحدة الأمريكية	نيس فرنسا