



دورة مبادئ الاستثمار وقرارات المحفظة



دورة مبادئ الاستثمار وقرارات المحفظة

المرجع: 416_133763 التاريخ: 28 مارس – 1 أبريل 2027 المكان: كيب تاون الرسوم: Euro 4500

نظرة عامة

دورة مبادئ الاستثمار وقرارات المحفظة هي دورة تأسيسية مدتها 5 أيام لمهنيي المالية والخزينة ودعم الاستثمار والعلاقات، ويغادر المشاركون منها بدفتر قرارات مبادئ الاستثمار. تربط الدورة أهداف الاستثمار وهيكل الأسواق والقيمة الزمنية للنقود والمخاطر والعائد وفئات الأصول وتحليل الأوراق المالية وأسس التقييم والتنويع وبناء المحفظة ومراجعة الأداء. تقدم أجائل للتدريب هذه الدورة في مبادئ الاستثمار وقرارات المحفظة.

الفئة المستهدفة

- وظائف المالية المسؤولة عن دعم تحليل الاستثمارات وسجلات القرار
- وظائف الخزينة المسؤولة عن استثمارات السيولة ومقارنات المخاطر والعائد
- وظائف دعم الاستثمار المسؤولة عن البيانات والأدوات والتقارير وإدارة المحافظ
- وظائف العلاقات المسؤولة عن مناقشة الأهداف والقيود والخيارات الاستثمارية
- وظائف التخطيط المؤسسي المسؤولة عن تقييم البدائل المالية وأدلة تخصيص رأس المال
- المهنيون المنتقلون إلى أدوار الاستثمار أو إدارة الأصول أو دعم المحافظ

تفترض الدورة أن المشاركين يستخدمون معلومات مالية أساسية في عملهم، ولا تتناول تسعير المشتقات المتقدم أو المشورة المنظمة أو تنفيذ التداول أو الإعداد للاختبارات المهنية.

الإدارات والقطاعات المستهدفة

تدعم الدورة قرارات الاستثمار التأسيسية في البيئات المالية والمؤسسية والاستشارية.

- إدارات المالية والخزينة والاستثمار والتخطيط المؤسسي
- فرق إدارة الأصول ودعم الثروات وعمليات الاستثمار
- مؤسسات المصارف والتأمين والتقاعد والخدمات المهنية
- مؤسسات التقنية والاتصالات والتصنيع والطاقة
- مؤسسات الرعاية الصحية والتعليم والقطاع غير الربحي
- وظائف دعم المكاتب العائلية والأوقاف والمؤسسات



أهداف التعلم

بنهاية هذه الدورة، سيتمكن المشاركون من:

- تطبيق أهداف الاستثمار وقيوده على موجز قرار
- استخدام حسابات القيمة الزمنية لمقارنة الخيارات المالية
- مقارنة أدوات الأسهم والدين والاستثمار المجمع والأصول البديلة
- تحليل أدلة قيمة الورقة المالية والعائد والمخاطر
- بناء تخصيص محفظة متنوعة باستخدام الارتباط وملفات المخاطر
- تقييم أداء المحفظة مقابل الأهداف ومؤشر معياري مناسب

جدول الدورة

اليوم 1: سياق الاستثمار وأهدافه

- خريطة المشاركين في قطاع الاستثمار ووظائفهم
- مخطط عمليات الأسواق الأولية والثانوية
- بيان أهداف المستثمر وقيوده
- ملف تحمل المخاطر والقدرة عليها
- قائمة فحص حوكمة قرار الاستثمار

اليوم 2: القيمة الزمنية والعائد والمخاطر

- ورقة حساب القيمة الحالية والمستقبلية
- طريقة مقارنة صافي القيمة الحالية
- مقاييس عائد فترة الاحتفاظ والعائد السنوي
- أداة تشخيص التشتت والتقلب
- شبكة قرار المفاضلة بين المخاطر والعائد



اليوم 3: الأدوات وأسس التقييم

- مصفوفة خصائص الأوراق المالية للأسهم
- خريطة التدفقات النقدية والعائد لأدوات الدين
- مقارنة أدوات الاستثمار المجمع
- تقييم دور الأصول البديلة
- ورقة افتراضات التقييم الأساسي للأوراق المالية

اليوم 4: التنويع وبناء المحفظة

- ملف المخاطر والعائد لفئات الأصول
- تحليل الارتباط والتنويع
- إطار التخصيص الاستراتيجي للأصول
- نموذج أوزان المحفظة وقيودها
- بطاقة مراجعة المؤشر المعياري والأداء

اليوم 5: ممارسة قرار الاستثمار

- تمرين مقترح: تشخيص الأهداف والقيود
- تمرين مقترح: مقارنة القيمة الزمنية والعائد
- تمرين مقترح: مراجعة الأدوات والتقييم
- تمرين مقترح: التخصيص المتنوع وفحص الأداء
- التمرين الختامي: دفتر قرارات مبادئ الاستثمار

التمارين التطبيقية

تستخدم الدورة أنشطة مقترحة لربط أدلة السوق والحسابات والأدوات وخيارات المحفظة.

- نشاط مقترح: تحويل حالة مستثمر إلى أهداف وقيود وتحمل للمخاطر ومعايير قرار.
- نشاط مقترح: مقارنة التدفقات النقدية باستخدام حسابات القيمة الزمنية والعائد والمخاطر.
- نشاط مقترح: تصنيف الأدوات وتسجيل افتراضات التقييم والمزايا والقيود وأدوار المحفظة.
- نشاط مقترح: بناء تخصيص واختبار التنويع ومراجعة أدلة الأداء مقابل الأهداف.



الأسئلة الشائعة

لمن تناسب دورة مبادئ الاستثمار وقرارات المحفظة وماذا تفترض؟

تناسب دورة مبادئ الاستثمار المهنيين الذين يستخدمون معلومات مالية أساسية ويحتاجون أساسا منظما للأسواق والأدوات والمخاطر والعائد والتقييم وقرارات المحفظة.

كيف تختلف مبادئ الاستثمار عن الإدارة المتقدمة للمحافظ؟

تبنى مبادئ الاستثمار المفاهيم والحسابات ومقارنات الأدوات وقرارات التخصيص البسيطة، بينما تستخدم الإدارة المتقدمة نماذج كمية أعمق وأساليب تحسين واستراتيجيات نشطة وتحليل أداء معقد.

لماذا تهتم القيمة الزمنية للنقود في قرارات الاستثمار؟

تجعل القيمة الزمنية التدفقات النقدية في أوقات مختلفة قابلة للمقارنة عبر حسابات القيمة الحالية والمستقبلية، وتدعم تقييما متسقا للبدائل الاستثمارية.

كيف يؤثر التنوع في مخاطر المحفظة الاستثمارية؟

يمكن للتنوع خفض التركيز والمخاطر الخاصة بالأصل عندما تستجيب مقتنيات المحفظة بصورة مختلفة لظروف السوق، لكنه لا يزيل جميع مصادر الخسارة.

ما الأدلة التي تدعم قرار المحفظة الاستثمارية؟

يربط قرار المحفظة بين الأهداف والقيود وخصائص الأدوات وافتراسات التقييم والعائد المتوقع ومقاييس المخاطر والارتباطات وأوزان التخصيص والسيولة والتكاليف ومعايير مراجعة الأداء.

الخاتمة

يغادر المشاركون بدفتر قرارات مبادئ الاستثمار الذي يضم الأهداف والحسابات ومقارنات الأدوات وافتراسات التقييم وملفات المخاطر والتخصيص وسجلات الأداء. يحول الدفتر المدخلات المالية المتفرقة إلى عملية قرار استثماري قابلة للتتبع. ويدعم المقارنة المتسقة والافتراضات الموثقة وخيارات التنوع والمراجعة مقابل الأهداف.