دورة قياس مخاطر السوق وإدارتها

31 أكتوبر – 4 نوفمبر 2027

الكويت

AGILE LEADERS
Training Center

AGILE LEADERS
Training Center

دورة قياس مخاطر السوق وإدارتها

المرجع: 191926_1244 **التاريخ:** 31 أكتوبر – 4 نوفمبر 2027 **المكان:** الكويت **الرسوم:** Euro 5500

نظرة عامة

تقدم دورة قياس مخاطر السوق وإدارتها برنامجا متقدما لمدة أسبوع للمتخصصين الذين يقيسون الخسائر الناتجة عن حركة الأسعار والمعدلات ويجمعونها ويضعون حدودها ويتحدون نتائجها ويرفعون تقاريرها. يربط المشاركون بين عوامل المخاطر وبيانات المراكز والتقييم والحساسيات والقيمة المعرضة للخطر والعجز المتوقع واختبارات الضغط والاختبار الرجعي وآفاق السيولة ومخاطر الأساس والحدود وضوابط التقييم وحوكمة النماذج.

يبني كل مشارك إطار قياس وحدود لمخاطر السوق لمحفظة أو نشاط تداول مختار. ويضم الإطار فهرس عوامل المخاطر وخريطة الحساسيات ومجموعة القياسات وقواعد التجميع ومكتبة الضغط وتصميم الاختبار الرجعي وهندسة الحدود وواجهة ضوابط التقييم وضوابط حوكمة النماذج ولوحة التقارير. تقدم أجايل للتدريب إدارة مخاطر السوق كنظام مترابط يجمع المراكز والبيانات والنماذج والضوابط والحكم المهني والعمل المسؤول.

الفئة المستهدفة

- مديرو ومحللو مخاطر السوق وفرق الرقابة على المخاطر
- فرق الخزانة والتداول والاستثمار وإدارة الميزانية والمحافظ
- مختصو المخاطر الكمية وتطوير النماذج والتحقق منها
- فرق رقابة المنتجات والتقييم والمالية والتقارير التنظيمية
- فرق بيانات المخاطر والتقنية والتحليلات الداعمة لمحركات القياس
- فرق التدقيق والضمان والامتثال والحوكمة
- القيادات وأعضاء اللجان الذين يراجعون التعرض والحدود ورأس المال

تفترض الدورة معرفة بالأدوات المالية والمحافظ والإحصاء الأساسي. ولا تقدم توصيات تداول أو استثمار ولا تعتمد نموذجا تنظيميا ولا تستبدل التحقق والتفسير المحاسبي والرأسمالي والرقابي الخاص بالمؤسسة.

AGILE LEADERS
Training Center

أهداف الدورة

- ربط المراكز بمخاطر أسعار الفائدة والعملات والأسهم والسلع وفروق الائتمان والتقلب والأساس
- حساب الحساسيات والقيمة المعرضة للخطر والعجز المتوقع وخسائر الضغط وتفسيرها
- فهم التنويع والتركيز والارتباط والاختيارية وآثار السيولة
- تصميم حدود تربط صلاحيات الأعمال بشهية المخاطر والقياسات والتصعيد
- بناء الاختبار الرجعي وتحليل الأداء لكشف ضعف النماذج
- ربط التحقق المستقل من الأسعار وعدم يقين التقييم والاحتياطيات بمخاطر السوق
- حوكمة البيانات والبدائل والافتراضات وتغييرات النماذج والتحقق والاستخدام
- إعداد تقارير تدعم قرارات مكاتب التداول واللجان والقيادات والمجلس

المنتج التطبيقي

يبني المشاركون إطار قياس وحدود لمخاطر السوق يتضمن:

- فهرس المحفظة وعوامل المخاطر
- خريطة الحساسيات والتعرضات
- مواصفات القيمة المعرضة للخطر والعجز المتوقع
- مكتبة الضغط والضغط العكسي
- عملية الاختبار الرجعي والاستثناءات
- هندسة الحدود والتصعيد
- واجهة التقييم وضوابط بيانات السوق
- قائمة حوكمة النماذج
- لوحة مخاطر السوق وسجل الإجراءات

اليوم 1: المراكز وعوامل المخاطر والحساسيات

- تصنيف مخاطر السوق وحدودها مع مخاطر الائتمان والطرف المقابل والسيولة
- تمثيل المراكز والتدفقات والمنحنيات والأسطح والأسعار والفروق والبيانات المرجعية
- فجوات الفائدة والمدة وPV01 والتحدب وحساسية العملات والأسهم والسلع
- دلتا وغاما وفيغا وثيتا الخيارات وأسطح التقلب والمخاطر غير الخطية
- مخاطر الأساس والارتباط والتركيز والقفز والمخاطر المتبقية

ورشة تطبيقية: إعداد فهرس عوامل وخريطة حساسيات لمحفظة مختلطة وتحديد التعرض الناقص أو المكرر.

AGILE LEADERS
Training Center

اليوم 2: القيمة المعرضة للخطر والعجز المتوقع والتجميع

- الأساليب المعلمية والتاريخية والمحاكاة للقيمة المعرضة للخطر
- مستوى الثقة وفترة الاحتفاظ ونافذة البيانات والترجيح والتحجيم والافتراضات
- العجز المتوقع وخسائر الذيل وآفاق السيولة وعوامل المخاطر غير القابلة للنمذجة
- تجميع المحفظة والتنويع وعدم استقرار الارتباط والتركيز
- تفسير القياسات للحدود ورأس المال والتسعير وقرارات الإدارة

ورشة تطبيقية: تحديد مجموعة قياسات ومقارنة الحساسيات والقيمة والعجز والتركيز للمحفظة نفسها.

اليوم 3: اختبارات الضغط والاختبار الرجعي وأداء النماذج

- السيناريوهات التاريخية والافتراضية والحساسية ومتعددة العوامل والضغط العكسي
- شدة السيناريو ومعقوليته واتساقه وتغطيته وسرده
- ربط الأحداث بالأسعار والفروق والعملات والأسهم والسلع والتقلب
- الاختبار الرجعي وتعريف الأرباح والخسائر والاستثناءات والإسناد والتصعيد
- انحراف النماذج وضعف البيانات ومخاطر البدائل وتغير الأنظمة

ورشة تطبيقية: بناء مكتبة ضغط وعملية اختبار رجعي بحدود ومالكين وتحليل استثناءات ومعالجة.

اليوم 4: الحدود وضوابط التقييم والإدارة اليومية

- صلاحيات المكتب وحدود التعرض والحساسية والقيمة والضغط والتركيز ووقف الخسارة
- تخصيص الحدود واستخدامها والمراقبة خلال اليوم ومعالجة التجاوز والزيادات المؤقتة
- حوكمة بيانات السوق والأسعار القديمة والقيم الشاذة والبدائل ومسار البيانات
- التحقق المستقل من الأسعار وتعديلات التقييم وعدم اليقين والاحتياطيات
- تقارير الأرباح والخسائر والإسناد والحركة غير المفسرة والتفاعل مع رقابة المنتجات

ورشة تطبيقية: تصميم هيكل حدود وحزمة يومية تربط التعرض والتقييم والأرباح والتجاوزات بالإجراءات.

AGILE LEADERS
Training Center

اليوم 5: حوكمة النماذج وسياق رأس المال والتقارير

- حوكمة دفتر التداول وسياق القياس التنظيمي والأساليب المعيارية والداخلية
- فهرس النماذج وملكيتها وتطويرها والتحقق منها واعتمادها وتنفيذها وتغييرها
- اختبار الاستخدام والقيود والتجاوزات والضوابط التعويضية والمراجعة المستقلة
- تقارير مكاتب التداول ولجان إدارة الميزانية والمخاطر والقيادات والمجالس
- تقويم الحوكمة ومراجعة المخاطر الناشئة وقائمة التنفيذ لمدة تسعين يوما

المشروع الختامي: عرض إطار القياس والحدود واختباره أمام لجنة مخاطر محاكية.

أساليب التدريب

- تمارين المحافظ ورسم عوامل المخاطر
- مقارنة الحساسيات والقيمة والعجز والضغط
- حالات الاختبار الرجعي والاستثناءات وأداء النماذج
- ورش الحدود وضوابط التقييم والتقارير
- مراجعة جماعية لأطر القياس واللوحات

مخرجات الدورة

يغادر المشاركون وهم قادرون على ربط المراكز والبيانات بقياسات متكاملة وتحدي نتائج النماذج وتصميم ضغوط وحدود موثوقة والتحقيق في الاستثناءات وعرض التعرض والعمل المطلوب بوضوح. كما يفهمون موضع الحكم المهني والتقييم والتحقق والحوكمة إلى جانب القياس.

أسئلة شائعة

هل هذه دورة لبناء النماذج كميا؟

تطور فهما متقدما للقياس والحوكمة لكنها لا تعلم البرمجة أو بناء النموذج بالكامل.

هل تغطي مفاهيم الإطار الأساسي لمراجعة دفتر التداول؟

نعم، تشرح حدود دفتر التداول والعجز المتوقع وآفاق السيولة والعوامل غير القابلة للنمذجة وسياق الحوكمة.

هل تقتصر على المصارف؟

لا، تنطبق الأساليب أيضا على محافظ الاستثمار والخزانة والسلع والمؤسسات المعرضة للسوق.

ما المنتج الذي سأعده؟

ستنجز إطار قياس وحدود يشمل العوامل والقياسات والضغط والاختبار الرجعي والحدود والتقييم والنماذج والتقارير.