دورة إدارة مخاطر الاستثمار لمديري الأصول

11 – 15 أكتوبر 2027

ميونخ

AGILE LEADERS
Training Center

AGILE LEADERS
Training Center

دورة إدارة مخاطر الاستثمار لمديري الأصول

المرجع: 194254_1275 **التاريخ:** 11 – 15 أكتوبر 2027 **المكان:** ميونخ **الرسوم:** Euro 5700

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 والتصعيد وقرارات اللجنة. تقدم أجايل 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 وتصعيد 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

AGILE LEADERS
Training Center

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 والتعهيد
- 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

AGILE LEADERS
Training Center

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.

AGILE LEADERS
Training Center

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 المتحملة 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 وتقارير اللجان. يأخذ المشاركون حزمة حوكمة مخاطر المحفظة التي تضم الخرائط والجداول واللوحات واختبارات الضغط والسجلات وقرارات الحوكمة. تنشئ الحزمة مسارا متكررا من تفويض المحفظة إلى تعرض مقاس واستثناء محكوم وقرار استثماري موثق.