

النشرة الفنية لبرنامج

إدارة المحافظ الاستثمارية والهندسة المالية

Investment Portfolio Management and Financial Engineering

5 أيام، 25 ساعة

يبدأ بتاريخ 2024/11/24م

تدريب صفي (F2F) - الاردن

بطاقة معلومات البرنامج:

مدة التدريب	: (5) أيام، (25) ساعة
نمط التدريب	: تدريب صفي - قاعات الجهود - الاردن
تاريخ الانعقاد	: 11/24 وحتى 2024/11/28 م
توقيت التدريب	: 09:00 صباحاً لغاية 02:00 ظهراً بتوقيت الاردن
شهادة التدريب	: شهادة صادرة من مجموعة الجهود المشتركة
لغة التدريب	: اللغة العربية مع بعض المصطلحات الفنية باللغة الإنجليزية

أساليب التدريب	: - أسلوب السيناريوهات. - أسلوب العصف الذهني. - أسلوب تمارين وأنشطة الفريق. - أسلوب تقديم الحلول والممارسات. - أسلوب تمارين لعب الأدوار والتدريبات الجماعية وتبادل الخبرات.
----------------	---

الفئة المستهدفة	: - العاملين في مجال التحليل المالي. - العاملين في مجال الهندسة المالية وادارتها. - العاملين في مجال المحافظ الاستثمارية وادارتها. - العاملين في مجالات الأسواق المالية والوساطة المالية والبورصة.
-----------------	---

ادارة المحافظ الاستثمارية والهندسة المالية :

المحفظة الاستثمارية هي مجموعة من الأصول المالية التي يحتفظ بها المستثمر بهدف تحقيق أهداف مالية مُحدَّدة، تشمل المحفظة الاستثمارية الأصول المالية مثل الأسهم والسندات وصناديق الاستثمار المتداولة والعقارات وغيرها من الأدوات المالية، يتمثل الهدف من إنشاء المحافظ الاستثمارية في التنوع وتخفيض المخاطر وتحقيق النمو المالي على المدى الطويل. من خلال الاستثمار في مجموعة مُتنوِّعة من الأصول، يُمكن للمستثمر توزيع مخاطره عبر مختلف أنواع الأوراق المالية والصناعات، وبالتالي تحقيق عوائد أعلى مُقارنةً بالاستثمار في أصل واحد.

أدى التغير المستمر في البيئة المالية والاستثمارية إلى ضرورة البحث عن أدوات ومنتجات مالية جديدة تتمتع بأقل تكلفة وأدنى مخاطر وأعلى عائد. وتضم الهندسة المالية مجموعة واسعة ومتعددة من الأدوات المالية الجديدة ومن بينها الخيارات المالية التي تعد أدوات مالية جوهرية يتوجب على مديري المحافظ الاستثمارية في العديد من الأسواق المالية العربية والدولية فهمها.

يتم إنشاء المحفظة الاستثمارية عادةً بناءً على أهداف المستثمر المالية ومدى قبوله للمخاطر بالإضافة إلى مُدَّة الاستثمار. على سبيل المثال، يحرص المستثمر الحذر على إنشاء محفظة استثمارية تُركِّز بشكلٍ كبير على أصول الدخل الثابت مثل السندات، في حين قد يمتلك المستثمر الجريء محفظة تُركِّز بشكلٍ كبير على الأسهم، كما يمكن إدارة المحفظة

الاستثمارية من قبل المُستثمر نفسه أو من قبل مُدير استثمار مُحترف يقوم بمُراجعة المحفظة الاستثمارية بانتظام لضمان أن تكون متوافقة مع أهداف المُستثمر ومدى قبوله للمخاطر. بشكل عام، تُعدّ المحفظة الاستثمارية أداة قيمة لتحقيق النمو المالي على المدى الطويل وتحقيق الأهداف الماليّة.

الجدارات المستهدفة في التطوير:

- جدارة تقويم المشروعات الاستثمارية.
- جدارة تقييم صناديق الاستثمار المشتركة.
- جدارة تخطيط بناء المحفظة الاستثمارية.
- جدارة التنبؤ بالطلب على المحافظ الاستثمارية.
- جدارة تكوين المحفظة الاستثمارية وتحليلها وتقييمها.
- جدارة تطبيق الهندسة المالية وتسوية الصفقات المالية.
- جدارة تطبيق تحليل الفني للأسهم واستراتيجيات الاستثمار.
- جدارة تقييم اداء وقياس العوائد على المحافظ الاستثمارية.

أهداف البرنامج التدريبي:

في نهاية التدريب سيكون المشاركون ملمين من :

- الالام بالسياسات المالية و النقدية وأثرها على الإستثمار.
- قياس أداء محافظ الأوراق المالية وصناديق الإستثمار.
- تحليل آثار الابتكار التكنولوجي والعولمة والعوامل الخارجية.
- كيفية بناء الاستراتيجيات وقواعد إدارة المحافظ الاستثمارية.
- مهارات تحليل الإستثمارات واتخاذ القرارات في إدارة المحافظ.
- ماهية وأساليب الهندسة المالية وطرق تخفيض المخاطر التي يتعرض لها المستثمرون.
- ماهية الإستثمار وإدارة المحافظ الاستثمارية وكيفية تكوين المحفظة وتحليلها وإدارتها وطرق تقييمها.
- تطوير استراتيجية استثمار بناء على أساسيات المخاطر والعوائد ودمج استراتيجيات كمية أكثر تطوراً.
- التعرف على ادوات سوق المال التي تسهم في تحقيق مزيد من الربحية وتخفيض المخاطر لأقل درجة ممكنة.
- الالام بقرارات الإستثمار التي تؤثر على الأهداف الاستراتيجية والمالية للمنظمة واساسيات اتخاذ القرار الاستثماري.
- التعامل مع صيغ التقييم المختلفة لتحديد العوائد المتوقعة ودمج التمويل السلوكي في تحليل الإستثمارات وسلوك السوق.

المحور الأول: الهندسة المالية Financial Engineering

- مفهوم الهندسة المالية.
- أهمية الهندسة المالية.
- أهداف الهندسة المالية.
- أدوات الهندسة المالية.
- الهندسة المالية والمشتقات.
- استخدامات الهندسة المالية.
- مميزات تطبيق الهندسة المالية.
- مهارات الهندسة المالية ومسئولياتها.
- الهندسة المالية وتسوية الصفقات المالية.
- آثار الهندسة المالية على السياسات الاقتصادية.
- تطبيقات الهندسة المالية في مجال البنوك ومبررات استخدامها.
- الابتكارات الجديدة في الأدوات المالية وأهمها الخيارات والمستقبلات وشركات الاستثمار.

المحور الثاني: الاستثمار في الأسواق المالية

- مفهوم الاستثمار وأنواعه.
- دور البورصة في الإقتصاد.
- أطراف التداول في الأسواق المالية.
- الأسواق المالية و الأسواق النقدية.
- مفهوم الإستثمار في الأسواق المالية.
- تحليل الفائدة والسياسات الاقتصادية.
- القيمة الزمنية للنقد و طرق حسابها.
- السياسة النقدية وأثرها على قرارات الإستثمار.
- الأسواق المالية الأولية و الثانوية والفرق بينهما.
- استراتيجيات الاستثمار في السندات الحكومية.
- أساليب التحليل الفني للأسهم واستراتيجيات الاستثمار.
- كفاءة الأسواق المالية وأهميتها في تقويم الاستثمارات المالية.
- استخدام استراتيجيات توزيع الأصول لتحقيق التوازن المثلى.
- استراتيجيات التحوط للتعامل مع التقلبات في معدلات الفائدة.
- تأثير التغيرات في معدلات الفائدة وكيفية تحديدها على قيمة السندات.

المحور الثالث : تكوين المحفظة الاستثمارية وتحليلها

- مفهوم المحفظة الإستثمارية.
- طرق الإستثمار في الأوراق المالية.
- الصفات والجدارات مدير المحفظة.

- أسس إدارة المحافظ الاستثمارية.
- التخطيط لبناء المحافظ الاستثمارية.
- العائد على الاستثمار وتقرير الأموال.
- أنواع المحافظ الإستثمارية و أهدافها.
- التحليل الإستثماري لمكونات المحفظة.
- صناديق الإستثمار المشترك و تقييمها.
- المهارات الواجب توافرها في مدير المحفظة.
- اتخاذ القرارات الإستثمارية في إدارة المحافظ.
- إستراتيجيات إختيار الأسهم و التداول عليها.
- معرفة آثار التنوع واختيار المحفظة المالية الكفؤة.
- أسس ومعايير اختيار الأسهم والتحرك في السوق.
- دراسة الأساليب والطرق المتبعة في تقويم المشروعات الاستثمارية.
- تكوين وإدارة المحافظ الاستثمارية وطرق حساب عوائدها ومخاطرها.
- تطبيق الأساليب القياسية في التنبؤ بالطلب على المحافظ الاستثمارية.
- أساليب إدارة المحافظ والطرق المتبعة في اتخاذ قرارات البيع والشراء.

المحور الرابع : الإدارة المثلى للمحافظ الإستثمارية

- العائد على الإستثمار.
- تقييم الأسهم و السندات.
- صافي القيمة الحالية للعائد.
- العائد على حقوق المساهمين.
- التنوع في المحفظة الإستثمارية.
- إدارة المخاطر الإستثمارية وتقييمها.
- النظرية الحديثة لإدارة المحفظة الإستثمارية.
- الأسس المطلوب توافرها لإدارة المحفظة الإستثمارية.
- تقييم أداء و قياس العوائد علي المحافظ الإستثمارية.
- تطبيقات عملية.

إنتهت النشرة الفنية ،