

النشرة الفنية لبرنامج
التحليل والتنبؤ المالي لغايات النمذجة المالية
Financial modeling, Analysis and Forecasting

(5) أيام، (15) ساعة
يبدأ بتاريخ 2023/03/12م
القاهرة - مصر

بطاقة معلومات البرنامج:

مدة التدريب	: (5) أيام، (15) ساعة
مكان الانعقاد	: القاهرة – مصر
توقيت التدريب	: سيتم تحديده قبل اسبوع من تاريخ البرنامج
تاريخ الانعقاد	: 2023/03/16 - 12م
شهادة التدريب	: شهادة صادرة من مجموعة الجهود المشتركة (لاتقل نسبة الحضور عن 90%)
لغة التدريب	: اللغة العربية مع بعض المصطلحات الفنية باللغة الإنجليزية

أساليب التدريب	: <ul style="list-style-type: none">- أسلوب العصف الذهني.- أسلوب دراسات الحالة من الواقع.- أسلوب تطوير مادة تدريبية تفاعلية.- التطبيقات العملية بإستخدام الحاسوب.- أسلوب اكتساب خبرات من تجارب المشاركين.- استخدام البرنامج الاحصائي القياسي (E-views).
القيمة المضافة	: <ul style="list-style-type: none">- عقد تقييم قبلي Pre: لقياس مستوى المشاركين قبل التدريب.- عقد تقييم بعدي Post: لقياس مستوى المشاركين بعد التدريب.- قياس القيمة المعرفية المضافة (KVA) = التقييم البعدي – التقييم القبلي

الفئة المستهدفة	: <ul style="list-style-type: none">- المدققون الداخليون.- المدراء الماليون ومساعدتهم.- المراقبون ومسؤولو الخزينة.- مدراء الاستثمار في المنظمات.- المتخصصون في مجال البحوث والتطوير.- المحاسبون، الماليون ومديرو المشروعات ومحللو الميزانية.- كل من يحتاج الى تفسير وتحليل البيانات المالية وإستخدامها في وضع ورصد التنبؤات والتوقعات المالية في مؤسساتهم.
-----------------	--

أهمية تدريب وتطوير الكفاءات في علم النمذجة المالية:

النمذجة المالية هي عملية بناء التصور للأداء المالي للمنظمة من خلال استخدام نماذج إحصائية قياسية يتم فيها ربط المتغيرات المالية معاً واستنتاج العلاقات بينهم، وذلك بهدف اتخاذ قرارات العمل المناسبة، حيث تعتبر النماذج المالية من الأدوات الفعالة التي يمكنها مساعدة المنظمة على توضيح أدائها الحالي وتوقع أدائها المالي في المستقبل، كما يمكن أن تساعد النماذج المالية في تقييم المنظمات لأغراض الاندماج والاستحواذ، والطرح الأولي للاكتتاب العام، وذلك من خلال استخدام جداول وقوائم مايكروسوفت إكسل واستخدام برامج إحصائية قياسية دقيقة مثل برنامج E-views.

ويقوم الهدف الرئيسي في النمذجة المالية على بناء نموذج لتقييم الأداء المالي للمنظمات من خلال استخدام أدوات النمذجة المالية وتطبيقها المالية بهدف التنبؤ بالأداء المالي لأغراض التخطيط واتخاذ القرارات. حيث ان مخرجات النمذجة المالية تساعد في تقييم الأداء المالي للمنظمات واتخاذ العديد من القرارات مثل زيادة رأس مال الشركة، القيام بعمليات استحواذ، فتح منفذ بيع أو متجر جديد، بيع أو تخريد الأصول، تقييم الأعمال وتحليل القوائم المالية. ولأن المعرفة الوثيقة بمبادئ التحليل المالي والقدرة على التنبؤ إحدى القدرات الأساسية اللازمة لإدارة المنظمات بكفاءة؛ صممت مجموعة الجهود المشتركة هذا البرنامج التدريبي حول النمذجة المالية ومقاييس التنبؤ، إذ إنها ستستخدم مبادئ التحليل لتحديد العوامل الإستراتيجية التي تعزز القيمة التي يحصل عليها المشاركون.

أهداف البرنامج التدريبي:

يهدف البرنامج التدريبي الى مساعدة المشاركين على الإلمام بالمفاهيم الضرورية التي تساعدهم على نمذجة البيانات المالية لاستخدامها في التحليل والتنبؤ المالي، وذلك من خلال التركيز على ما يلي:

- تعريف المشاركين بأهم البيانات والمؤشرات المالية ومصادرها، وإكسابهم مهارات جمع وتبويب وتحليل البيانات المالية وطرق عرضها.
- تعزيز قدراتهم في اكتساب المهارات اللازمة لإستخدام البرنامج القياسي (E-views) لغايات النمذجة المالية والتنبؤ والسيناريوهات ذات العلاقة.
- تعزيز قدراتهم في الدقة في إجراء التقديرات والإختبارات الإحصائية وتحليلها وعرضها وإختيار وتطبيق النماذج الإقتصادية والقياسية المناسبة.
- الإلمام بالأساليب الالكترونية المتقدمة لاعداد الخطط والموازنات المالية التي يتم التركيز من خلالها على تحليل الاهداف الاساسية الى فرعية وتحديد معدلات الاداء لقياس مدى التقدم استناداً الى مؤشرات الكفاءة والفعالية.

الجدارات المستهدفة:

- جدارة نمذجة البيانات المالية.
- جدارة التنبؤ واتخاذ القرارات المالية المستقبلية.
- جدارة إستخدام البرامج المتقدمة في نمذجة البيانات المالية.
- جدارة تطبيق وظائف وأدوات البرنامج الاحصائي القياسي (E-views).

المحاور الرئيسية للتدريب:

المحور الأول: البيانات المالية

- طبيعة ومفهوم البيانات المالية.
- أهمية ومخاطر البيانات المالية.
- الفرق بين البيانات والمعلومات المالية.
- المتغيرات الكمية والمتغيرات النوعية.
- المتغيرات التابعة والمتغيرات المستقلة.
- بيانات السلاسل الزمنية والبيانات المقطعية.
- تحويل البيانات المالية (Data Transformation).
- مصادر جمع البيانات المالية وطرق جمع البيانات المالية.

المحور الثاني: نمذجة البيانات المالية

- أساسيات التحليل المالي.
- مفهوم نمذجة البيانات المالية.
- تطور علم نمذجة البيانات المالية.
- دور نمذجة البيانات المالية في التحليل.
- دور نمذجة البيانات المالية في التنبؤ واتخاذ القرارات المستقبلية.

المحور الثالث: أساسيات استخدام برنامج (E-Views)

- مقدمة تعريفية عن برنامج E-Views.
- عملية انشاء الملفات.
- عملية ادخال البيانات.
- إطار عمل الرسم البياني.
- معالجة وتحليل بيانات السلاسل الزمنية.

المحور الرابع: الإحصاءات الوصفية للبيانات المالية وتطبيقاتها على برنامج (E-Views)

- (الوسط الحسابي، الوسيط، المنوال).
- مقاييس التشتت (Dispersion Measures).
- (المدى، الانحراف المعياري، التباين).
- استخراج الإحصائيات الوصفية باستخدام E-views.
- مقاييس النزعة المركزية (Central Tendency Measures).

المحور الخامس: الارتباط والسببية والانحدار بين البيانات المالية وتطبيقاتها على برنامج (E-Views)

- الارتباط (The Correlation).
- اختبار السببية (Causality Test).

- طريقة الانحدار (The Regression).

المحور السادس : تحليل البيانات والسلاسل الزمنية

- اختبار جذر الوحدة (Unit Root Test).
- تحليل البيانات والسلاسل الزمنية لغايات التنبؤ.
- اختبار التكامل المشترك (Cointegration Test).
- تشخيص النماذج القياسية:
 - الارتباط التسلسلي (Residual Serial Correlation Test).
 - عدم تجانس التباين (Residual Heteroscedasticity Test).
 - الارتباط الخطي المتعدد (Residual Multicollinearity Test).
- استخدام النماذج القياسية (OLS, VAR, VECM, ARDL):
 - نموذج (Vector autoregression).
 - نموذج (ordinary least squares).
 - نموذج (vector error correction model).
 - نموذج (Autoregressive Distributed Lag).