

دورة تحليل معدل القيمة المعرضة للخطر (VAR):  
إتقان إدارة المخاطر والعوائد المالية

9 - 13 مايو 2027

المنامة (البحرين)

UK Traininig

**PARTNER**



## دورة تحليل معدل القيمة المعرضة للخطر (VAR): إتقان إدارة المخاطر والعوائد المالية

المرجع: 185294\_3255023 التاريخ: 9 - 13 مايو 2027 المكان: المنامة (البحرين) الرسوم: GBP 4200

### مقدمة

في بيئة الأعمال الحديثة، أصبحت القرارات المالية الدقيقة أكثر أهمية من أي وقت مضى. تمنحك دورة تحليل معدل القيمة المعرضة للخطر VAR: إتقان إدارة المخاطر والعوائد المالية القدرة على تقييم المخاطر المالية بدقة، وتحليل العوائد المحتملة، وبناء استراتيجيات استثمار أكثر أمانًا وفعالية. تستهدف هذه الدورة المديرين التنفيذيين، وقادة الفرق، والمتخصصين في الإدارات المالية، والمخاطر، والاستثمار في المؤسسات الحكومية والخاصة بمنطقة الشرق الأوسط وشمال أفريقيا. إذا كنت تطمح إلى اكتساب خبرة متقدمة في تحليل المخاطر المالية، ودعم قراراتك الاستثمارية بمعايير علمية دقيقة، فهذه الدورة تمثل خطوة استراتيجية مهمة في مسارك المهني.

### أهداف الدورة

- فهم المفاهيم الأساسية لمعدل القيمة المعرضة للخطر VAR واستخداماته العملية.
- تطبيق أدوات التحليل المتقدمة لتقدير المخاطر المالية.
- تقييم العلاقة بين المخاطر والعوائد في القرارات الاستثمارية.
- تحليل السيناريوهات المتوقعة وتقدير الخسائر المحتملة.
- تصميم استراتيجيات لإدارة المخاطر بشكل استباقي.
- إعداد تقارير تحليلية تدعم القرارات التنفيذية.
- تحسين القدرة على التواصل الفعال مع فرق الإدارة العليا حول النتائج المالية.
- تعزيز الكفاءة في بناء نماذج تقييم المخاطر المالية.

UK Traininig

**PARTNER**



## محاور الدورة

### اليوم الأول: مقدمة في إدارة المخاطر ومفهوم VAR

- التعريف بإدارة المخاطر المالية وأهميتها في المؤسسات.
- شرح مفهوم معدل القيمة المعرضة للخطر VAR ودوره في التحليل المالي.
- مقارنة VAR بأساليب تقييم المخاطر الأخرى.
- علاقة VAR بالعائد المالي وتقييم المحفظة الاستثمارية.
- مقدمة في نماذج توزيع الخسائر وتحليل السيناريوهات.
- تمرين تفاعلي: تقدير مبسط لمعدل VAR باستخدام أمثلة عملية.

### اليوم الثاني: جمع البيانات وتحضيرها لتحليل المخاطر

- تحديد مصادر البيانات المالية الداخلية والخارجية.
- أساليب جمع البيانات التاريخية للتحليل الكمي.
- تنظيف البيانات والتحقق من جودتها ومصداقيتها.
- إعداد البيانات لبناء نماذج VAR بدقة.
- استكشاف الأنماط التاريخية لتقدير المخاطر المستقبلية.
- نشاط جماعي: تجهيز قاعدة بيانات فعلية للتحليل.

### اليوم الثالث: تقنيات التحليل المتقدم لقياس VAR

- أساليب تقدير VAR الطريقة التحليلية، المحاكاة التاريخية، المحاكاة المونتية.
- تحليل العوائد الموزعة واحتمالات الخسارة القصوى.
- استخدام النماذج الإحصائية لتقدير المخاطر المالية.
- أدوات وتقنيات متقدمة لتقييم الحساسية وتقلبات السوق.
- تمرين عملي: بناء نموذج VAR لسيناريو مالي حقيقي.
- ورشة عمل: إعداد تقرير تحليلي مبني على نتائج النموذج.

UK Training

**PARTNER**



## اليوم الرابع: تطبيقات عملية واستراتيجيات التحوط

- كيفية استخدام نتائج VAR في إدارة المحافظ الاستثمارية.
- استراتيجيات التحوط ضد المخاطر المالية المختلفة.
- إعداد خطط الطوارئ بناءً على نتائج التحليلات.
- دمج تحليلات VAR في القرارات المالية الاستراتيجية.
- تمرين عملي: تصميم خطة تحوط مالية شاملة.
- مناقشة جماعية: دراسة حالة لشركة استثمارية.

## اليوم الخامس: التقييم الختامي وعرض المشاريع العملية

- مراجعة شاملة لجميع مفاهيم الدورة وأهم الأدوات المستخدمة.
- تقديم المشاريع العملية الفردية والجماعية.
- تلقي الملاحظات التفصيلية والتوصيات من الخبراء.
- إعداد خطط العمل لتطبيق المعارف في بيئة العمل الحقيقية.
- توزيع الشهادات وجلسة ختامية لتبادل الخبرات.
- تلخيص النقاط الرئيسية وأهم الدروس المستفادة.

## لماذا يجب عليك حضور هذه الدورة؟ الإيجابيات والسلبيات

- اكتساب خبرة متقدمة في قياس المخاطر المالية باستخدام VAR.
- تحسين القدرة على تقييم العوائد واتخاذ قرارات استثمارية أفضل.
- تطوير مهارات التحليل الكمي والاستراتيجي.
- دعم خطط التحوط وتقليل الخسائر المحتملة.
- تعزيز مكانتك المهنية عبر شهادة معتمدة متخصصة.
- بناء قدرة أكبر على التواصل مع فرق الإدارة حول المخاطر.
- تعلم استخدام أحدث الأدوات التحليلية والنماذج المالية.
- توسيع شبكة العلاقات المهنية مع خبراء ماليين آخرين.

## الخاتمة

تعد دورة تحليل معدل القيمة المعرضة للخطر VAR: إتقان إدارة المخاطر والعوائد المالية فرصة فريدة لكل قائد أو خبير مالي يسعى إلى تحسين قدراته التحليلية، ودعم قراراته الاستثمارية بالبيانات الدقيقة والنماذج المتقدمة.

UK Traininig

**PARTNER**



من خلال المحتوى العملي، والتمارين، ودراسات الحالة الواقعية، ستصبح قادرًا على تقديم توصيات مالية مبنية على أسس علمية، وتقليل المخاطر المالية، وتعظيم العوائد لمؤسستك. انضم الآن، وابدأ في تحويل استراتيجياتك المالية إلى خطط أكثر أمانًا ونجاحًا، وتعزيز دورك كقائد مالي استراتيجي قادر على مواجهة تحديات السوق بثقة.

UK Traininig

**PARTNER**

