CONCEPT

دورة شهادة التعامل الدولية ACI لمحترفي الخزينة

17 – 21 مايو 2027

باريس - فندق أعمال على الضفة اليمنى



دورة شهادة التعامل الدولية ACI لمحترفي الخزينة

المرجع: 31293_2253 **التاريخ:** 17 – 21 مايو 2027 **المكان:** باريس - فندق أعمال على الضفة اليمنى **الرسوم:** SAR 23500

مقدمة:

البرنامج التحضيري لاختبار شهادة التعامل الدولية ACI برنامج متخصص مدته أسبوع، موجه إلى مسؤولي تداول الخزينة وأخصائيي تنفيذ الصرف الأجنبي ومشغلي أسواق النقد ومراقبي المخاطر، ويختتم بإعداد ملف تنفيذ عمليات الخزينة وضبط المخاطر المعتمد. تؤدي آليات التسعير غير المنسقة وضعف مطابقة التأكيدات وحسابات الانكشافات الخاطئة في المشتقات إلى إخفاقات تسوية جسيمة وتجاوز حدود الامتثال الرقابي داخل قاعات التداول. ويمتلك المرشحون دراية بتسجيل المعاملات بين البنوك واحتساب استحقاقات الفوائد ومتابعة السيولة اليومية، ويتلقون التدريب عبر محاكاة واقعية لقاعات التداول. وتقدم كور كونسبت هذا البرنامج لترسيخ معايير التنفيذ والامتثال الأخلاقي في عمليات الخزينة.

أهداف الدورة:

- تنفيذ حسابات تسعير الصرف الأجنبي الفوري والآجل ومبادلات العملات بالاعتماد على الأعراف السوقية وقواعد حساب الأيام
- احتساب التدفقات النقدية لأسواق النقد والتواريخ المكسورة والاستيفاء الخطي لهياكل الودائع ذات الفائدة البسيطة والمركبة
- هيكلة اتفاقيات الأسعار الآجلة ومبادلات المؤشرات لليلة واحدة ومبادلات أسعار الفائدة لتغطية الانكشافات المؤسسية
- تطبيق مبادئ FX Global Code في تنفيذ المعاملات وإجراءات التحوط المسبق والتعامل مع الأوامر وسرية المعلومات
- قياس انكشافات مخاطر السوق في قاعات التداول باستخدام قيمة النقطة الأساسية ومدة الاستحقاق ومنهجيات القيمة العادلة
- تدقيق مسارات تسجيل الصفقات ومطابقة التأكيدات لتفادي تعثر المعالجة المباشرة واختلافات التسوية بين البنوك

الفئة المستهدفة:

- مسؤولو التداول المبتدئون في الخزينة المعنيون بتنفيذ عمليات الصرف الأجنبي الفوري والآجل ضمن الحدود المقررة
- أخصائيو عمليات أسواق النقد المكلفون بإدارة السيولة اليومية وتوظيف الودائع وإبرام معاملات التمويل بين البنوك
- محللو المكتب الأوسط في الخزينة المسؤولون عن مطابقة تأكيدات الصفقات وإعادة تقييم المراكز وتثبيت أسعار الفائدة
- مسؤولو مراقبة مخاطر السوق المعنيون بمتابعة حدود المتعاملين وحساسية نقاط الأساس وانكشافات القيمة المعرضة للمخاطر
- مسؤولو الامتثال في الخزينة المكلفون بتطبيق معايير السلوك المهني ومراقبة حظر إساءة استخدام السوق وفق المدونات المعتمدة

محاور الدورة:

اليوم 1: بيئة الأسواق المالية وبنية التداول وقواعد السلوك المهني

- إطار منهج ACI FMA لتنظيم الهيكل التشغيلي لقاعات تداول الخزينة الحديثة
- مبادئ مدونة FX Global Code الحاكمة لنزاهة تنفيذ المعاملات وسرية البيانات
- منظومات المعالجة المباشرة وضوابط بروتوكولات تسجيل الصفقات بين البنوك
- معايير اتفاقية Basel III لإدارة نسب تغطية السيولة والتمويل المستقر الصافي
- قواعد مطابقة تأكيدات المعاملات لمنع إخفاقات التسوية التشغيلية في الخزينة

اليوم 2: آليات الصرف الأجنبي وأسس التسعير ومبادلات العملات

- أعراف تسعير الصرف الأجنبي الفوري لحساب أسعار الشراء والبيع المتبادلة
- معادلات العقود الآجلة لتحديد نقاط المبادلة وتسعير التواريخ المكسورة
- هياكل مبادلات الصرف الأجنبي وفق مبدأ تكافؤ أسعار الفائدة المغطاة
- عقود الصرف الآجلة غير القابلة للتسليم لتسوية فروقات العملات غير المحولة
- عوائد خيارات العملات لتقييم مراكز خيارات الشراء والبيع وهياكل الحماية

اليوم 3: أدوات أسواق النقد وحسابات الأيام والعمليات الحسابية لأسعار الفائدة

- اتفاقيات الأيام الفعلية 360 والفعلية 365 لحساب فوائد أسواق النقد
- قواعد يوم العمل المعدل التالي لتحديد تسويات مواعيد التداول والاستحقاق
- تقنيات الاستيفاء الخطي لتسعير ودائع التمويل ذات الآجال غير القياسية
- معادلات عوائد أذون الخزانة لحساب أسعار الخصم ومعدلات العائد الاستثماري
- آليات اتفاقيات إعادة الشراء وحساب هوامش الضمان الأولية والتغيرات السعرية

اليوم 4: مشتقات الدخل الثابت والعملات والسلع وضوابط حدود المخاطر

- اتفاقيات الأسعار الآجلة لحساب مبالغ تسوية الأصل الاسمي وتغطية التذبذب
- تقييم مبادلات المؤشرات لليلة واحدة وتتبع مؤشرات الفائدة القياسية المركبة
- عقود مبادلات أسعار الفائدة لتبادل التدفقات النقدية الثابتة والمتغيرة
- رياضيات أدوات الدخل الثابت لحساب مدة الاستحقاق وقيمة النقطة الأساسية
- منهجيات التقييم وفق القيمة السوقية العادلة لاحتساب تكلفة استبدال المراكز

اليوم 5: محاكاة قاعة التداول وتنفيذ العمليات واعتماد الملف النهائي

- منصة تداول افتراضية بين البنوك لتنفيذ تسعير حي لعقود الصرف الفورية
- محاكاة هيكلة مبادلات العملات الآجلة لحل طلبات التسعير للفترات المكسورة
- تسجيل صفقات المشتقات الافتراضية للتحقق من مطابقة المعالجة المباشرة
- تدقيق محاكي لمخاطر قاعة التداول لتقييم حساسية المراكز والالتزام بالحدود
- ملف تنفيذ عمليات الخزينة وضبط المخاطر لاعتماد جاهزية المتداولين الفنية

المهارات التي ستكتسبها:

- تسعير عقود الصرف الأجنبي الفورية والآجلة
- حساب فوائد أسواق النقد وفق اتفاقيات الأيام
- تطبيق متطلبات الامتثال لمدونة FX Global Code
- هيكلة تدفقات عقود مبادلات أسعار الفائدة
- مطابقة وتسجيل صفقات قاعات التداول
- قياس مدة الاستحقاق وقيمة النقطة الأساسية للسندات
- تقييم هوامش الضمان لاتفاقيات إعادة الشراء

لماذا تحضر هذه الدورة:

- تقديم ملف تنفيذ عمليات الخزينة وضبط المخاطر المعتمد لرئيس الخزينة للتأكد من الجاهزية التشغيلية وكفاءة التنفيذ.
- تحديد أسعار الشراء والبيع ونسب التحوط بدقة عبر أسواق الصرف الفورية وأسواق أسعار الفائدة قصيرة الأجل.
- تفادي التسعير الخاطئ للنقاط الآجلة وأخطاء تسوية الفترات المكسورة وتجاوزات السلوك المهني في قاعات التداول.
- نقل بروتوكولات تسجيل الصفقات الموحدة وطرق الاستيفاء الخطي وممارسات مدونة السلوك لفرق العمل في الخزينة.

الخاتمة:

تعتمد المنشأة إثر ختام البرنامج ملف تنفيذ عمليات الخزينة وضبط المخاطر لتوحيد ممارسات التداول والتحقق من الجاهزية التشغيلية لفرق العمل. ويستند رؤساء الخزينة ومسؤولو الرقابة في المكتب الأوسط ومديرو الامتثال إلى هذا المخرج لتفويض صلاحيات التنفيذ للمتعاملين والتحقق من سلامة التحوط والمصادقة على استخدام أنظمة التداول المباشرة. وتتولى لجان الخزينة بعد شهر تدقيق سجلات المطابقة بعد التداول وتقارير الالتزام بحدود المراكز لضمان بقاء العمليات ضمن معايير إدارة المخاطر المعتمدة.

الأسئلة الشائعة:

ما الفئات الوظيفية المرشحة لحضور البرنامج التحضيري لاختبار شهادة التعامل الدولية ACI؟

يناسب مسؤولي تداول الخزينة الجدد وأخصائيي أسواق النقد وموظفي تأكيد صفقات المكتب الأوسط ومحللي المخاطر. وتتولى هذه الكوادر إدارة السيولة النقدية اليومية وتسعير الصرف الأجنبي الفوري والآجل وتدقيق العمليات والتأكد من مطابقة المعاملات في قاعات التداول.

ما المتطلبات المهنية المسبقة للمشاركة في البرنامج التحضيري لاختبار شهادة التعامل الدولية ACI؟

يتعين على المرشحين امتلاك خبرة في قيد صفقات الخزينة واحتساب فوائد الودائع البسيطة وقراءة الكشوف المصرفية الرسمية. وتساعد المعرفة السابقة بشاشات التسعير بين البنوك والصيغ الحسابية في الجداول المالية على التطبيق الفوري لسيناريوهات التسعير السريعة.

ما المخرج العملي الذي تحققه المنشأة من البرنامج التحضيري لاختبار شهادة التعامل الدولية ACI؟

تحصل المنشأة على ملف تنفيذ عمليات الخزينة وضبط المخاطر كوثيقة مهنية معتمدة. وتضم الحقيبة نماذج تسعير مدققة وجداول استيفاء النقاط الآجلة وقوائم التحقق من الامتثال لمدونة السلوك وسجلات محاكاة التداول لمراجعتها واعتمادها من الإدارة.

ما الأطر والمعايير المعتمدة في البرنامج التحضيري لاختبار شهادة التعامل الدولية ACI؟

يتبع البرنامج منهج جمعية الأسواق المالية ACI FMA برقم الإصدار 002-101 ومدونة السلوك للأسواق المالية FX Global Code. وتتطابق تطبيقاته مع أعراف التداول المصرفي الدولي ومبادئ مراقبة السيولة Basel III وحسابات أسواق السندات والعملات.