دورة الذكاء الاصطناعي في إدارة الاستثمار: البحث وقرارات المحفظة والرقابة على النماذج

28 فبراير – 4 مارس 2027

كوالالمبور

دورة الذكاء الاصطناعي في إدارة الاستثمار: البحث وقرارات المحفظة والرقابة على النماذج

المرجع: 824_38486 **التاريخ:** 28 فبراير – 4 مارس 2027 **المكان:** كوالالمبور **الرسوم:** GBP 4000

ملخص البرنامج

الذكاء الاصطناعي في إدارة الاستثمار محور دورة تدريبية تمتد أسبوع لقادة الاستثمار والمخاطر والصناديق، ويخرج منها كل مشارك بحزمة الرقابة على النماذج لعملية استثمارية واحدة. تستخدم فرق البحث الاستثماري وإشارات تعلم الآلة وبناء المحافظ أدوات جديدة بسرعة، بينما تبقى المساءلة عن القرار عند القادة الذين لا يبنون النماذج بأنفسهم. وينتقل البرنامج من خريطة العملية الاستثمارية وقراءة الاختبارات الرجعية إلى حدود المخاطر والتحقق المستقل وضبط الاعتماد على الموردين. تقدم مارس للتدريب المملكة المتحدة هذا البرنامج في الذكاء الاصطناعي في إدارة الاستثمار لمجموعات من مؤسسات مختلفة.

المبررات المؤسسية

تعتمد مؤسسات الاستثمار على نتائج نماذج لا يراجعها غير مختصين قلائل، فيصل الاختبار الرجعي المتفائل أو البيانات المتسربة إلى لجنة الاستثمار على هيئة قناعة. ويمنح الإشراف المنظم القادة أسئلة محددة يطرحونها قبل أن يتحول الإشعار إلى مركز في المحفظة.

- مخاطر النماذج: تنخفض حين تفحص الاختبارات الرجعية والتسرب والإفراط في المطابقة قبل الاعتماد.
- جودة قرار المحفظة: ترتفع حين تقاس الإشارات على معيار مقارن وتفسر أمام لجنة الاستثمار.
- التعرض لجهات خارجية: ينخفض حين يسجل الاعتماد على الموردين وتراقب النماذج بعد التشغيل.

المبادئ والأساس المعرفي

- إرشادات IOSCO المنظمة الدولية لهيئات الأوراق المالية بشأن الذكاء الاصطناعي وتعلم الآلة: تقدم ست تدابير تشمل إشراف الإدارة العليا والتطوير والاختبار والمعرفة والمهارات ورقابة الأطراف الثالثة والإفصاح للعملاء والضوابط، وتطبق في الجلستين 3 و4.
- تقرير IOSCO عن الذكاء الاصطناعي في أسواق المال: يعرض حالات الاستخدام ومخاطر النماذج وجودة البيانات والتركز لدى مزودي الخدمة والسلوك القطيعي، ويطبق في الجلسة 3 على مراجعة التزاحم.
- المعيار ISO/IEC 42001 لنظام إدارة الذكاء الاصطناعي: يقدم إطارا للحوكمة والمساءلة، ويطبق في الجلسة 4 على خطة التحقق ومراقبة النماذج.

المشاركون المستهدفون

- قادة الاستثمار الذين يوافقون على استخدام الإشارات والنماذج في قرارات المحفظة.
- مسؤولو المخاطر الذين يضعون حدود المراكز وسيناريوهات الضغط.
- رؤساء البحث الذين يدخلون النماذج اللغوية والبيانات البديلة إلى عملهم.
- مسؤولو الامتثال والتحقق من النماذج الذين يراجعون الأدلة قبل الاعتماد.
- مديرو الصناديق الذين يخاطبون العملاء بشأن استخدام هذه الأدوات.

تشمل البيئات المعتادة شركات إدارة الأصول والبنوك والصناديق السيادية وصناديق التقاعد.

مخرجات التعلم

1. سيكون المشاركون قادرين على تقييم مواضع استخدام الذكاء الاصطناعي في العملية الاستثمارية بحسب القيمة والدليل.
2. سيكون المشاركون قادرين على تشخيص ضعف الاختبارات الرجعية من تسرب البيانات والإفراط في المطابقة والتحيز.
3. سيكون المشاركون قادرين على بناء حدود للمراكز ودوران المحفظة وسيناريوهات ضغط لاستخدام الإشارات.
4. سيكون المشاركون قادرين على تصميم خطة تحقق وتحد مستقل ومراقبة للنموذج.
5. سيكون المشاركون قادرين على ترتيب أولويات المخاطر المرتبطة بالموردين والإفصاح للعملاء.
6. سيكون المشاركون قادرين على تبرير حزمة رقابة أمام لجنة الاستثمار.

هيكل البرنامج

اليوم 1: أسس الذكاء الاصطناعي في إدارة الاستثمار

أين يضيف الذكاء الاصطناعي قيمة في العملية الاستثمارية وما دليل ذلك؟

- خريطة العملية الاستثمارية
- فهرس حالات استخدام الذكاء الاصطناعي
- مراجعة مصادر البيانات البديلة
- سير عمل البحث بالنماذج اللغوية
- شبكة تقييم القيمة والدليل

اليوم 2: قراءة الإشارات والاختبارات الرجعية

كيف يعرف القائد أن الإشارة تصمد خارج بيانات التجربة؟

- ورقة تصميم الاختبار الرجعي
- قائمة فحص تسرب البيانات
- تشخيص الإفراط في المطابقة
- جدول المقارنة بالمعيار
- مراجعة التحيز عبر أنظمة السوق المختلفة

اليوم 3: استخدام المحفظة وحدود المخاطر

كيف تدخل الإشارة قرار المحفظة ضمن حدود يفهمها الراعي؟

- خريطة دعم بناء المحافظ
- ورقة حدود المراكز والدوران
- مجموعة سيناريوهات الضغط
- مراجعة التزاحم والسلوك القطيعي
- قالب إحاطة قابلية التفسير

اليوم 4: التحقق من النماذج وضبط الأطراف الثالثة

من يتحدى النموذج، وكيف تراقب المؤسسة اعتمادها على الموردين؟

- خطة التحقق من النماذج
- بروتوكول التحدي المستقل
- سجل الاعتماد على الموردين
- لوحة مراقبة النماذج
- بيان الإفصاح للعملاء

اليوم 5: حزمة الرقابة على النماذج لعملية استثمارية واحدة

هل تتكامل الأدوات السابقة في حزمة تعتمدها لجنة الاستثمار؟

- تطبيق شبكة تقييم القيمة والدليل من الجلسة 1
- اختبار قائمة فحص تسرب البيانات من الجلسة 2
- فحص ورقة حدود المراكز والدوران من الجلسة 3
- تدريب على تحدي لجنة الاستثمار
- إنجاز حزمة الرقابة على النماذج

المنهجية

يقوم البرنامج على تمارين منظمة تستند إلى مواد حالات جاهزة لعمليتين استثماريتين، إحداهما استراتيجية أسهم تعتمد على النماذج اللغوية والأخرى محفظة دخل ثابت تستخدم بيانات بديلة. يعمل المشاركون في مجموعات ويدافعون عن قراراتهم أمام زملاء يؤدون دور لجنة الاستثمار.

- نشاط مقترح: البحث عن تسرب خفي في اختبار رجعي يظهر أداء مرتفعا.
- نشاط مقترح: إعادة ضبط حدود المراكز بعد سيناريو ضغط يتزاحم فيه المستثمرون.
- نشاط مقترح: الرد على أسئلة لجنة الاستثمار بشأن نموذج يصعب تفسيره.

المخرج الختامي

يعد كل مشارك حزمة الرقابة على النماذج لعملية استثمارية واحدة. وتضم شبكة تقييم القيمة والدليل وقائمة فحص التسرب وحدود المراكز وخطة التحقق وسجل الموردين وبيان الإفصاح بأسماء المسؤولين. وتستخدم في العمل لإحاطة لجنة الاستثمار ولتحديد ما يراجع قبل اعتماد أي نموذج.

الأسئلة الشائعة

هل تناسب دورة تدريبية في الذكاء الاصطناعي في إدارة الاستثمار القادة الذين لا يبنون النماذج؟

نعم، إذ تدرس الذكاء الاصطناعي في إدارة الاستثمار عبر حالات جاهزة وقوالب دون برمجة. ويفترض البرنامج مسؤولية عن الاستثمار أو المخاطر أو الصناديق، دون عمل سابق على بناء النماذج.

على أي معايير وإرشادات يقوم الذكاء الاصطناعي في إدارة الاستثمار؟

يقوم الذكاء الاصطناعي في إدارة الاستثمار على إرشادات IOSCO وتقريرها عن الذكاء الاصطناعي في أسواق المال، وعلى المعيار ISO/IEC 42001 للحوكمة، وتطبق جميعها على حالات استثمارية جاهزة.

كيف تستخدم حزمة الرقابة من الذكاء الاصطناعي في إدارة الاستثمار في العمل؟

تستخدم الحزمة لإحاطة لجنة الاستثمار، ولتوحيد أسئلة البحث والمخاطر والامتثال قبل اعتماد النموذج، ولبيان ما يراقب بعد التشغيل ومن يملكه.

بماذا يختلف الذكاء الاصطناعي في إدارة الاستثمار عن برنامج في التمويل الكمي؟

يركز الذكاء الاصطناعي في إدارة الاستثمار على الرقابة والمساءلة عن النماذج وقرارات المحفظة، بينما يركز برنامج التمويل الكمي على بناء النماذج الرياضية وتقدير المعاملات.