

دليل المستخدم



10010101

PoMaTo

Portfolio Management Tool

=== PoMaTo بيانات تعريف دليل مستخدم ===

الإصدار: EN v10.1

التاريخ: 22 سبتمبر 2025

PoMaTo الصيانة: فريق

=====



مقدمة

(أداة إدارة المحفظة) عبارة عن منصة استثمارية على مستوى مؤسسي تم إنشاؤها لتمكين المستثمرين الأفراد **PoMaTo** والمحترفين من قدرات إدارة المحفظة المتقدمة.

أدوات كانت في السابق حكرًا على صناديق التحوط ومديري **PoMaTo** بدمج الأتمتة وتحسين الأداء والتصميم البديهي، يُقدّم الأصول. تدعم واجهته المُبسّطة وتحليلاته الفعّالة إدارةً فعّالة لمجموعة واسعة من استراتيجيات الاستثمار.

، "بمجموعة من مُحسّنات الاستثمار المُخصصة المُصممة خصيصًا لتُناسب مناهج مُتنوعة، بما في ذلك "البيع فقط **PoMaTo** و"البيع على المكشوف"، و"محايد السوق"، و"تكرار المؤشرات". تدعم المنصة دورة حياة الاستثمار بأكملها - بدءًا من بناء المحفظة وتنفيذها، وصولًا إلى المراقبة المستمرة وإعداد التقارير - وتتوافق مع فئات أصول مُتعددة، بما في ذلك الأسهم وصناديق الاستثمار المُتداولة، والسندات، والسلع، والفوركس، والعملات المُشفرة.

ويعمل كمرجع لإدارة المحفظة الفعّالة ، **PoMaTo** يوفر دليل المستخدم هذا شرحًا خطوة بخطوة لجميع ميزات ووظائف والمستنيرة.



محتويات

1	قبل أن تبدأ	6
1.1	بيانات الإدخال	6
1.2	الرئيسي PoMaTo مسرد	7
1.3	الاختصارات في التطبيق	10
1.4	الزر الجانبي الأحمر	10
2	دليل سريع	12
2.1	مقدمة	12
2.2	إنشاء المحفظة وإعداد الاستراتيجية	12
2.3	الفوركس مقابل الفوركس	12
2.4	إدارة محفظة النقد	12
2.5	مراقبة المحفظة	12
2.6	تحسين المحفظة	12
2.7	تشغيل المحسن	12
2.8	تشغيل المحسن	12
2.9	تجارة	12
2.10	الوظائف المتقدمة	12
3	PoMaTo مقدمة إلى	13
3.1	ملخص	13
3.2	www.thePoMaTo.com - تسجيل الدخول والتسجيل	14
3.3	البيانات والدقة	15
3.4	الأوراق المالية المتاحة	16
4	المحفظة وإعداد الاستراتيجية	17
4.1	الخطوة 1: المعلومات الأساسية	18
4.2	الخطوة 2: اختيار محفظة النموذج	19
4.3	الخطوة 3: اختيار البورصات/فئات الأصول	20
4.4	الخطوة 4: المحفظة الحالية وإدخال النقد	22
4.4.1	استيراد المحفظة الحالية	22
4.4.2	اليدوي للمحفظة الحالية	23
4.4.3	إدخال النقد	24
5	الفوركس مقابل العملات الأجنبية	25
6	إدارة محفظة النقد	26
6.1	إدارة النقد	26
6.2	إدارة النقد - الإيداع/السحب	26
6.3	إدارة النقد - كل شيء باستثناء الإيداع/السحب	28



6.4	إدارة النقد - الأرصدة بعملة مختلفة عن العملة الأساسية للمحفظة	30
7	مراقبة المحفظة	36
7.1	منظر	37
7.2	أداء	39
7.2.1	الأداء المطلق	40
7.2.2	الأداء النسبي	40
7.2.3	مصفوفة الأداء	41
7.3	تكوين الأصول	42
7.4	تكوين القطاع	42
7.4.1	القطاعات	43
7.4.2	الصناعات	43
7.4.3	الصناعات الفرعية	44
7.5	دولة	44
7.5.1	دولة	45
7.5.2	منطقة	45
7.5.3	نوع السوق	46
7.6	(VaR) القيمة المعرضة للمخاطر	46
7.6.1	حاضر	46
7.6.2	أفضل	47
7.7	صفات	48
7.8	إحصائيات المخاطر	49
8	تحسين المحفظة	50
8.1	إعدادات التحسين	50
8.1.1	قيود السوق والنقد	54
8.1.2	قيود النموذج	56
8.1.3	قيود المخاطر	60
8.1.4	قيود فئة الأصول	65
8.1.5	القيود القطاعية	67
8.1.6	القيود الجغرافية	71
8.1.7	القيود المفروضة على الدولة	74
8.1.8	قيود أمنية فردية	77
8.1.9	قيود الدخل الثابت	81
8.1.10	القيود المخصصة	84
9	تشغيل المحسن	89
9.1	تشغيل المحسن	89
9.1.1	وقت تشغيل المحسن	90



9.2	نتائج التحسين	90
9.2.1	الأوزان - تحقق	91
9.2.2	فحص القيد	92
9.2.3	فحص وكيل مُحسَّن الذكاء الاصطناعي	94
9.2.4	الموافقة على تشغيل التحسين	95
10	تداول المحفظة	95
10.1	PoMaTo تداول أي أوراق مالية متاحة داخل	97
10.1.2	تداول الفوركس	100
10.2	الأوراق المالية المملوكة في المحفظة التجارية	103
10.3	تداول نتائج التحسين	105
10.3.1	OPT تسجيل ومعالجة دورات	107
11	الميزات المتقدمة	112
11.1	النقد - إضافة تدفق البدء المفقود	113
11.1.1	تعديل إدخال سطر النقد الأصلي	113
11.1.2	إدخال خط نقدي جديد	114
11.2	تحرير المحفظة	115
11.3	إضافة أمان مفقود	116
11.4	التنزيلات 117	117
11.4.1	عينة - Matrix Var Covar	117
11.4.2	عينة - S بيتا	118
11.4.3	بيتا ل - عينة	118
12	PoMaTo نموذج القيمة النسبية للأسهم في	119
12.1	ما هذا؟	119
12.2	المبادئ الأساسية	119
12.3	119ماذا يفعل	119
12.4	كيف يعمل	120
12.5	لماذا هو قوي	120
12.6	PoMaTo مواقع العرض في	121
13	زائدة	122
13.1	حساب تعريفي	122
13.2	123 إعدادات	123
13.3	وظائف الدعم	124
14	الأسئلة الشائعة	125
15	PoMaTo قارن	129



1 قبل أن تبدأ

1.1 بيانات الإدخال

عندما تكون هناك حاجة إلى قيمة رقمية للنسب المئوية (مثل أوزان المحفظة أو حدود المخاطر أو القيود)، يجب في PoMaTo، عليك إدخال القيمة على مقياس عشري بين 0 و 1. على سبيل المثال

• 0 = 0%

• 0.5 = 50%

• 1 = 100%

يُطبّق هذا التنسيق على جميع حقول الإدخال الرقمية في المنصة ، مما يضمن دقة واتساق الحسابات. على سبيل المثال إذا أردت تحديد وزن سهم واحد كحد أقصى بنسبة 7.5%، يجب عليك إدخال 0.075 (أي $7.5/100 = 0.075$)

• مثال: قيد أمان واحد

% في لقطة الشاشة أدناه، على مستوى المحفظة ، تم ضبط الحد الأدنى لوزن السهم الواحد على 0 ، أي 0

% وتم ضبط الحد الأقصى لوزن السهم الواحد على 0.075 ، أي 7.5

: ما يلي "Baader Bank AG" وبالمثل، ضمن مستوى الأمان ، يمتلك

• الحد الأدنى 0.01000 (1%) و

• الحد الأقصى 0.05000 (5%).

The screenshot shows the 'Optimization' tab in the PoMaTo software. Under the 'Settings' section, the 'Single Security Constraint' is selected. The 'Portfolio Level' section shows 'Single Stock Min Weight*' set to 0 and 'Single Stock Max Weight*' set to 0.075. The 'Security Level' section has an 'Add' button and a search bar. A table below lists the security 'Baader Bank AG' with a minimum weight of 0.01000 and a maximum weight of 0.05000. At the bottom, there are 'Restore default' and 'Save' buttons.

Security	MIN	MAX
Baader Bank AG	0.01000	0.05000

٪ نصيحة: تأكد دائماً من صحة إدخالك العشرية. إدخال ٠,٥ بدلاً من ٠,٠٥، يُغيّر القيمة من ٥ ٪ إلى ٥٠ ٪.



1.2 الرئيسي PoMaTo مسرد

فئة الأصول:

مجموعة من أنواع الاستثمارات المتشابهة، مثل الأسهم، والسندات، وصناديق الاستثمار المتداولة، والسلع، والعملات، أو النقد، فئات أصول متعددة، مع خطط للاستثمار في الأسهم، وصناديق الاستثمار المتداولة، والسندات، والمؤشرات PoMaTo يدعم والعملات الأجنبية المباشرة، والعملات المشفرة/السلع

معياري أو مؤشر

إجراء تحسينات بناءً على معايير مختارة PoMaTo يُستخدم لقياس أداء المحفظة. يمكن لـ (FTSE 100 أو S&P 500 مثل)

مُعَرَّف شبيه ببلومبرغ: مُعَرَّف مُوَلَّد

هذا التنسيق PoMaTo ليس مُعَرَّف ببلومبرغ رسميًا، إذ يُنشئ (XXX YY: مثل) صناعيًا، مُنَسَّق للتوافق مع سير عمل بلومبرغ عند الحاجة، استنادًا إلى رموز التبادل ورموز الدول

(السندات) BND

أداة دين تقرض من خلالها المال للحكومة أو الشركة في مقابل دفعات فائدة منتظمة وسدادها عند الاستحقاق

(العملة) CCY

تمثل النقود بعملة محددة

(السلع) CMD

مادة خام أو منتج زراعي أساسي يمكن شراؤه وبيعه، مثل الذهب أو النفط

CRY (Crypto)

عملة رقمية أو افتراضية مؤمنة بالتشفير

(CUSIP) لجنة إجراءات تعريف الأوراق المالية الموحدة:

للأوراق المالية في الولايات المتحدة وكندا. لا تُنشئ (CGS) العالمية CUSIP رمز أبجدي رقمي مكون من 9 أحرف، تُصدره خدمات رموزًا داخليًا بديلًا PoMaTo قد تُنشئ، CUSIP رسمية. في حال عدم وجود رمز CUSIP رموز PoMaTo

الفهرسة المباشرة

استراتيجية تسعى إلى تكرار مؤشر من خلال الاحتفاظ بالأوراق المالية المكونة له بشكل مباشر بدلاً من الاستثمار عبر صندوق الاستثمار المتداول أو صندوق الاستثمار المشترك

(حقوق الملكية) EQY

تمثل الملكية في الشركة، وعادةً ما تكون في شكل أسهم

(ETF) صندوق الاستثمار المتداول في البورصة

هو صندوق يتم تداوله في بورصة الأوراق المالية ويحمل سلة من الأصول (على سبيل المثال، الأسهم والسندات والسلع) للتنويع

فوركس (مركز استثماري)

مركز عملة يُحتفظ به كجزء من استراتيجية استثمار نشطة، ويُمثله زوج عملات (مثل: دولار أمريكي/يورو). يُصنف كأداة مالية PoMaTo ضمن

(الفوركس) FRX يمثل

إما كخطوط نقدية أو كفئة أصول، PoMaTo معاملات الصرف الأجنبي داخل

(العقود الآجلة) FUT

اتفاقية قانونية موحدة لشراء أو بيع أحد الأصول بسعر محدد مسبقًا في وقت محدد في المستقبل

إدارة النقد:

نقود مُحتفظ بها بعملات مختلفة لدعم أنشطة التداول فقط (وليس كاستثمار). تُدار كخطوط نقدية فردية



مُعَرَّف جوجل فاينانس

(رمز التبادل: رمز). تُصدر جوجل مُعرِّفات جوجل فاينانس الرسمية. في XX:YYY مُعرِّف مُستخدم في جوجل فاينانس، بالصيغة . مُعرِّفًا مُشابهًا لجوجل فاينانس PoMaTo حال عدم توفرها، يُنشئ

هي استراتيجية خاصة (RVEM) نموذج القيمة النسبية الهجينة للأسهم تجمع بين التحليل الأساسي للأسهم من القاعدة إلى القمة مع تقنيات كمية منهجية لتحديد الأسهم ذات الأسعار PoMaTo بشركة الخاطئة مع إدارة المخاطر

INDEX (مؤشر)

يُستخدم للمقارنة المعيارية أو تكرار المؤشرات (مثل FTSE 100) مجموعة من الأوراق المالية تُمثل قطاعًا من السوق

تكرار المؤشر

استراتيجية تهدف إلى مطابقة أداء مؤشر السوق من خلال الاحتفاظ بأوراق مالية مماثلة بنسب مماثلة

ISIN (رقم تعريف الأوراق المالية الدولي)

رمز أبجدي رقمي مكون من ١٢ حرفًا، تصدره وكالات التقييم الوطنية الرسمية لتحديد الأوراق المالية عالميًا بشكل فريد. لا تُنشئ رمزًا مُشابهًا PoMaTo أرقام تعريف دولية رسمية للأوراق المالية. إذا لم يكن للأوراق المالية رقم تعريف دولي، تُنشئ PoMaTo للاستخدام الداخلي فقط ISIN لرقم

LO (استراتيجية استثمارية طويلة الأجل)

حيث تشتري فقط الأصول المتوقع ارتفاع قيمتها؛ لا بيع على المكشوف

طويل-قصير (استراتيجية 130/30)

محفظة استثمارية طويلة بنسبة 130% (شراء الأوراق المالية المتوقع ارتفاعها) وقصيرة بنسبة 30% (بيع الأوراق المالية المقترضة المتوقع انخفاضها)، مع الحفاظ على التعرض الصافي للسوق عند 100

MN (الحيداد السوقي)

استراتيجية تهدف إلى إزالة مخاطر السوق من خلال موازنة المراكز الطويلة والقصيرة بحيث تعتمد العائدات بشكل أساسي على اختيار الأوراق المالية

OPT (الخيارات)

مشتق مالي يمنح المشتري الحق، ولكن ليس الالتزام، بشراء أو بيع أحد الأصول بسعر محدد قبل تاريخ محدد

تحسين

لتحديد أفضل مزيج من الأصول لتحقيق هدف معين مع مراعاة القيود مثل القطاع أو الجغرافيا أو مستويات النقد PoMaTo

إعادة موازنة المحفظة

تعديل الحيازات للحفاظ على تخصيص الأصول المطلوب بمرور الوقت

PoMaTo

"Management" من كلمة "Ma" والحرف، "Portfolio" من كلمة "Po" اختصار لـ "أداة إدارة المحفظة". يتكون من الحرف "Tool" من كلمة "To" والحرف

مُعَرَّف مُشابه لرويترز

ليس مُعرِّفًا رسميًا لرويترز، إذ يُنشئ (XXX.YY مثل) مُعرِّف مُولّد صناعيًا مُنسَّق للتوافق مع سير عمل رويترز/ريفيانيتيف. هذا التنسيق عند الحاجة، استنادًا إلى بيانات الرموز والبورصات PoMaTo

إدارة المخاطر

التي تحد من التعرض، وتتحكم في التقلبات، وتمنع التركيز في الأصول أو القطاعات الفردية PoMaTo أدوات وإعدادات

SEDOL (القائمة الرسمية اليومية للبورصة)

رمز أبجدي رقمي مكون من سبعة أحرف، تصدره بورصة لندن لتحديد الأوراق المالية في المملكة المتحدة وأيرلندا. لا تُنشئ رمزًا داخليًا بديلًا PoMaTo قد تُنشئ، SEDOL رسمية. في حال عدم وجود رمز SEDOL رموز PoMaTo



(Ticker) رمز التداول

(Apple Inc. لشركة AAPL ، على سبيل المثال) هو رمز فريد يتم تعيينه للأوراق المالية للتداول في البورصة

:تنفيذ التداول

مع الوسطاء لتنفيذها بنقرة واحدة PoMaTo عملية وضع أوامر البيع والشراء وإتمامها. يتكامل

التقلب

درجة التغير في سعر تداول أحد الأصول بمرور الوقت

الترجيح

هو النسبة المئوية من المحفظة المخصصة لأصل معين

:معرف ياهو فاينانس

(رمز التبادل). تُصدر ياهو مُعرّفات ياهو فاينانس الرسمية. في حال عدم XXX.YY مُعرّف يُستخدم في ياهو فاينانس، بتنسيق . مُعرّفًا مُشابهًا لمُعرّف ياهو فاينانس PoMaTo توفرها، يُنشئ



1.3 الاختصارات في التطبيق

لتصنيف الأوراق المالية PoMaTo الرموز المستخدمة في

اختصار	معنى
صافي القيمة	القيمة الصافية للأصول - إجمالي قيمة المحفظة بما في ذلك جميع الممتلكات والنقد.
الربح والخسارة	الربح والخسارة - الربح أو الخسارة المالية من الاستثمارات.
الربح والخسارة %	الربح والخسارة معبراً عنها كنسبة مئوية.
% فار	قيمة المخاطرة كنسبة مئوية من قيمة المحفظة.
التكلفة الإجمالية	التكلفة الإجمالية - تكلفة الاستحواذ المجمعة بما في ذلك الرسوم.
FX	صرف العملات الأجنبية - معاملات العملة (نقدًا أو استثمارًا).
نسخة	تغيير النقد - إدخال لتسجيل التعديلات النقدية اليدوية.
+CC / -CC	أضف (+) أو اطرح (-) الباقي من النقود.
إدارة تكنولوجيا المعلومات	منذ التأسيس حتى تاريخه - الأداء منذ إنشاء المحفظة.
YTD	حتى تاريخه - الأداء منذ بداية العام الحالي.
الربع الثالث	الربع حتى تاريخه - الأداء منذ بداية الربع الحالي.
إم تي دي	حتى تاريخه — الأداء منذ بداية الشهر الحالي.

1.4 الزر الجانبي الأحمر

قد يظهر زر جانبي أحمر على يمين الشاشة. يشير هذا الزر إلى توفر إجراءات أو موارد إضافية خاصة، PoMaTo في واجهة بالسياق للقسم الذي يتم عرضه. يؤدي الضغط على هذا الزر إلى فتح لوحة وصول سريع تتيح لك

- عرض الإرشادات أو التعليمات ذات الصلة بالشاشة الحالية
- توفير قوالب قابلة للتنزيل لاستيراد البيانات (على سبيل المثال، مقتنيات المحفظة، وسجل المعاملات)
- PoMaTo تقديم روابط لمواضيع المساعدة ذات الصلة ضمن دليل مستخدم

يصبح الزر الجانبي الأحمر مرئيًا فقط عندما تكون هناك إجراءات إضافية متاحة للصفحة النشطة.

Info Exchanges/Asset Class Cash Portfolio Optimization Trades

Advanced

Security Holdings OPT Recs

Enter a date range

25-07-2025 - 01-08-2025

Buy Sell

Search by security name

Date	Security	Quantity	Price	Cost	Fees	Tot Cost	
25-07-2025	Zinvest AG Type: EQY Country: Germany Trade CCY: EUR	117	12.2500	1,433.2500	3.2500	1,436.5000	
25-07-2025	Volkswagen AG Type: EQY Country: Germany Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	10,002.0000	
25-07-2025	Air France KLM SA Type: EQY Country: France Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	9,998.0000	



app.thepomato.com/dashboard/portfolios/44

PoMaTo

Fabio Agestini
agestini_fabio@hotmail.com

DASHBOARD
Portfolio management

- Portfolios
- New portfolio
- Securities
- Notifications

ACCOUNT
Account information

- Profile
- Settings

Portfolio UserGuideLO LONG ONLY

Code: UserGuideLO
Created on: 15-05-2025 [Clone](#)

Info Exchanges/Asset Class Cash Portfolio **Optimization** Trades

Long Only Long Short Market Neutral Indexing

Settings Results

Market and Cash Constraint

Asset Class Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Sector Constraint

Single Security Constraint

Single Stock Min Weight* 0

Portfolio Level Single 0.0%

Security Level


[Add](#)

Security

Load Weights File Excel

Your excel file must have the following header: **Ticker,Min,Max**
Otherwise, download the ready-made template to upload your weights!

[Weights Template](#)


Drag and drop Excel file or click here

[Cancel](#) [Save](#)



2 دليل سريع

2.1 مقدمة

PoMaTo يوفر نظرة عامة على نطاق البيانات والقدرات المتوفرة في

2.2 إنشاء المحفظة وإعداد الاستراتيجية

يغطي هذا الدليل عملية إنشاء محفظة استثمارية جديدة، بما في ذلك تحديد استراتيجية الاستثمار، ونوعها، واختيار معيار التقييم، والعملية الأساسية. يُحدد هذا الإعداد الأساسي كل إجراء لاحق ضمن المنصة

2.3 الفوركس مقابل الفوركس

محافظ متعددة العملات، حيث تُدار خطوط النقد الأجنبي **كعملات أجنبية** لتلبية احتياجات التداول، أو PoMaTo يدعم **عملة أجنبية** عند الاستثمار في استراتيجية استثمارية نشطة. يؤثر سعر صرف العملات الأجنبية على صافي قيمة الأصول من خلال أسعار الصرف، بينما تُنتج مراكز الفوركس كأزواج عملات

2.4 إدارة محفظة النقد

من تكرار وتسجيل عمليات الإيداع والسحب التي تتم لدى البنوك أو الوسطاء أو أمناء الحفظ بكفاءة. تضمن PoMaTo يُمكن هذه الوظيفة تشغيل المُحسن وأدوات إعداد التقارير باستخدام بيانات دقيقة ومُحدّثة. تُعد إدارة النقد السليمة أمرًا أساسيًا للحفاظ على انضباط الاستثمار ودعم تعديلات واقعية للمحفظة

2.5 مراقبة المحفظة

يقدم تعليمات خطوة بخطوة لمراقبة المحافظ، بما في ذلك فهم المقاييس الرئيسية مثل الأداء والتكوين والخصائص وإحصائيات المخاطر.

2.6 تحسين المحفظة

بين المخاطر والعوائد من خلال التنوع عبر الأصول والقطاعات والمناطق. يمكن للمستثمرين الاختيار من بين أربع PoMaTo خوارزميات خاصة بإعدادات وقيود قابلة للتخصيص لمواءمة محافظهم مع أهدافهم مع تجنب التركيز المفرط

2.7 تشغيل المُحسن

يصف كيفية تحديد القيود والتفضيلات قبل تشغيل المُحسن، بما في ذلك استخدام مدخلات البيانات المخصصة والمعلومات الأخرى التي توجه المُحسن لإنشاء محفظة تتوافق مع الأهداف الاستراتيجية

2.8 تشغيل المُحسن

بمجرد ضبط جميع المعلومات، يُمكن تشغيل المُحسن. يُحدد النظام المحفظة الأمثل رياضياً - موازنة المخاطر والعائد - مع مراعاة جميع القيود المحددة. والنتيجة هي توزيع موصى به مُصمم وفقاً لقواعد الاستثمار المُقدمة

2.9 تجارة

يمكن تسجيل نشاط التداول يدوياً أو يمكن تحميل المعاملات بشكل مجمع للحفاظ على محفظة محدثة

2.10 الوظائف المتقدمة

تتضمن الأدوات المتقدمة تحرير المحفظة، وتدقيق البداية المفقود، والبيانات القابلة للتنزيل. استخدم هذه الميزات لصيانة المحفظة، ومعالجة الاستثناءات، وتصدير البيانات لمزيد من التحليل أو لإعداد التقارير الخارجية



3 PoMaTo مقدمة إلى

3.1 ملخص

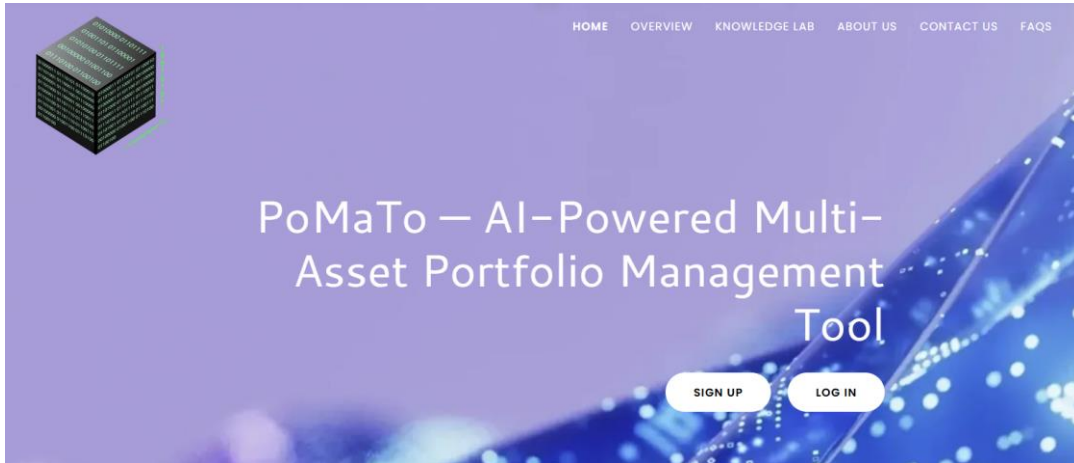
هو اختصار لعبارة "أداة إدارة المحافظ الاستثمارية". وهو تطبيق شامل مصمم لمساعدة المستثمرين الأفراد PoMaTo والخبراء الماليين على مراقبة محافظهم الاستثمارية وتحسينها وإدارتها بسهولة.

PoMaTo : يتيح

1. إنشاء وإدارة محافظ استثمارية عبر مجموعة واسعة من فئات الأصول، بما في ذلك
 - (a) الأسهم
 - (b) السندات
 - (c) صناديق الاستثمار المتداولة
 - (d) السلع الأساسية
 - (e) الفوركس
 - (f) العملات المشفرة
 - (g) نقدي
2. تحسين المحفظة الاستثمارية باستخدام مُحسّن ماركويتز لمتوسط التباين المتطور، القابل للتخصيص بالكامل لأي هدف أو استراتيجية استثمارية. تتوفر أربعة أنواع من المُحسّنات
 - (a) طويل فقط
 - (b) طويل قصير (130/30)
 - (c) محايد السوق
 - (d) الفهرسة المباشرة
3. مراقبة شاملة للمحفظة مع تحليلات ورؤى مفصلة، بما في ذلك
 - (a) الأداء (المطلق، النسبي، أو النشط)
 - (b) التكوين حسب فئة الأصول والقطاع والبلد
 - (c) القيمة المعرضة للمخاطر محسوبة في ظل سيناريوهات متعددة
 - (d) إحصاءات المخاطر بما في ذلك بيتا، والتقلب، وخطأ التتبع، والانخفاض، ونسبة شارب، ونسبة المعلومات
4. إدارة التدفقات النقدية للمحفظة من خلال تكرار الودائع والسحوبات مع البنوك أو الوسطاء أو الأمناء
5. وظيفة استيراد التجارة، التي تدعم الإدخال في الوقت الحقيقي والتحميل بالجملة عند إغلاق السوق
6. معالجة إجراءات الشركات مثل توزيعات الأرباح، والقسائم، وإصدارات الحقوق، وتقسيم الأسهم، والشركات الفرعية التي تؤثر على المحفظة
7. السلس مع منصات التداول من خلال إنشاء ملفات تجارية متوافقة



3.2 www.thePoMaTo.com – تسجيل الدخول والتسجيل



يتم عرض خيارين رئيسيين في وسط الشاشة، PoMaTo (thepomato.com) عند زيارة الصفحة الرئيسية لـ

- **التسجيل** – لإنشاء حساب جديد
- **تسجيل الدخول** - للوصول إلى حساب موجود

• كيفية التسجيل

1. حدد التسجيل
2. أدخل التفاصيل المطلوبة: الاسم والبريد الإلكتروني وكلمة المرور
3. قم بقبول الشروط والأحكام وسياسة الخصوصية
4. انقر فوق إنشاء حساب
5. سيتم إرسال بريد إلكتروني للتأكيد؛ اتبع الرابط المقدم لتفعيل الحساب

• كيفية تسجيل الدخول

1. حدد تسجيل الدخول
 2. أدخل البريد الإلكتروني المسجل وكلمة المرور
 3. انقر فوق تسجيل الدخول للوصول إلى لوحة المعلومات
 4. إذا نسيت كلمة المرور، حدد "نسيت كلمة المرور؟" لإعادة تعيينها
- نصيحة: بمجرد تسجيل الدخول، يمكنك الوصول إلى كافة ميزات إدارة المحفظة من القائمة الرئيسية



3.3 البيانات والدقة

مُجمّعة من مصادر متعددة متاحة للعامة. مع بذل كل جهد ممكن لضمان الدقة والموثوقية، لا **PoMaTo** البيانات التي تقدمها **PoMaTo** أي تعهد أو ضمان، صريحاً كان أم ضمنياً، بشأن دقة البيانات أو اكتمالها أو حداثة. لا تتحمل **PoMaTo** تُقدّم مسؤولية أي عدم دقة أو أخطاء أو سهو أو قرارات مُتخذة بناءً على هذه المعلومات.

ما يلي **PoMaTo** تتضمن البيانات المتوفرة داخل:

1. مؤشرات داخلية وتتيحها ضمن المنصة. مجموعات المعايير المُقدّمة هي **PoMaTo** معايير الأداء : تُطوّر
 - A. **مؤشرات كامي القياسية:** مؤشرات سوق الأصول المشتركة مصممة لتحقيق ارتباط لا يقل عن 95% مع ما يلي CAMI مؤشرات مزودي المؤشرات الرئيسيين . تشمل معايير:
 - (a) مؤشرات الأسهم
 - (b) مؤشرات السلع
 - (c) مؤشرات الدخل الثابت
 - (d) مؤشرات العملات المشفرة
 - (e) مؤشرات فئات الأصول المتعددة
 - B. **المرجعية :** مؤشرات أصول مباشرة مشتركة مصممة خصيصاً لاستراتيجيات الفهرسة المباشرة **CADI** مؤشرات تتمتع هذه المؤشرات بعلاقة ارتباط لا تقل عن 95% مع مزودي المؤشرات الرئيسيين (إن وُجدوا). تغطي مؤشرات المرجعية الأسهم فقط، وهي مؤشرات خاصة بكل بلد، ويقتصر كل منها على 50 عنصراً **CADI**.
- PoMaTo** معرفاً داخلياً ثابتاً مُحدداً وفقاً لرمز البورصة ومعرفها. من هذا التعيين، يستخرج **PoMaTo** **معرفات الأمان** : يستخدم لكل ورقة مالية، والذي يُستخدم كمعرف أساسي لتعيين معرفات إضافية داخل المنصة **ISIN** رمز.
 - A. رقم التعريف الدولي للأوراق المالية هو رمز أبجدي رقمي فريد مكون من 12 حرفاً، ويُستخدم : **ISIN** رمز رسمياً **ISIN** عالمياً لتعريف الأوراق المالية، مثل الأسهم والسندات. بالنسبة للأوراق المالية التي لا تحمل رقم **ISIN** رمزاً مُشابهاً لرقم **PoMaTo** (مثل العملات المشفرة)، يُنشئ إلى معرفات ياهو فاينانس، مما يُتيح بحثاً أمنياً فعالاً على ياهو **ISIN** معرف **ياهو فاينانس** : مُطابق من رقم مُعرف ياهو فاينانس مُركّباً **PoMaTo** فاينانس. إذا لم يُعطَ ياهو فاينانس سَوْفاً أو ورقة مالية مُحددة، يُنشئ هو رمز البورصة. الدقة غير مضمونة. يُسهّل هذا **YY** هو رمز البورصة و **XXX** حيث **XXX.YY** بتنسيق المطابقة الرجوع إلى مختلف المنصات.
 - C. **XX** حيث **XX:YYY**، **مُعرف جوجل فاينانس** : مُعَيّن بنفس الطريقة لجوجل فاينانس، باستخدام التنسيق هو رمز التبادل. تُولّد مُعرفات مُركّبة عند عدم توفّر التغطية؛ الدقة غير مضمونة **YYY** هو رمز التبادل و **مُعرفات بلومبرغ** الرسمية، بل يُولّد مُعرفات شبيهة ببلومبرغ **PoMaTo** **مُعرفات شبيهة ببلومبرغ** : لا يخزّن صُمّمت هذه المُعرفات للتوافق مع سير **XXX YY** اصطناعياً باستخدام رموز التبادل ورموز الدول بتنسيق عمل محطة بلومبرغ؛ ولا تُضمن دقتها.
 - E. **XXX.YY** معرف شبيه بمعرف رويترز : يتم إنشاء معرفات شبيهة بمعرفات رويترز الاصطناعية بتنسيق للتوافق مع سير عمل محطة رويترز؛ ولا يتم ضمان الدقة.

2. **الأوراق المالية :** يتم تصنيف كل ورقة مالية لتوفير معلومات مجمعة عن المحفظة وتمكين إعدادات المحسن، بما يتماشى مع أهداف الاستثمار.

التصنيفات تشمل:

- a. فئة الأصول (مصدر البيانات: أي) - تُستخدم في إعدادات المُحسّن
- b. القيمة السوقية (مصدر البيانات: البورصة) - تُستخدم في إعدادات المُحسّن
- c. الحجم (مصدر البيانات: البورصة) - عدد الأوراق المالية المتداولة؛ المستخدمة في إعدادات المُحسّن
- d. ولكنه لا **MSCI** القطاع (مصدر البيانات: علاقات المستثمرين) - تصنيف داخلي مشابه في التسمية لقطاعات ؛ يُستخدم في إعدادات المُحسّن وعرض تكوين المحفظة **MSCI** يمثل تصنيفات



- e. الصناعة (مصدر البيانات: علاقات المستثمرين) - التصنيف الداخلي؛ يُستخدم فقط لعرض تكوين المحفظة
- f. الصناعة الفرعية (مصدر البيانات: علاقات المستثمرين) - تصنيف داخلي؛ يُستخدم فقط لعرض تكوين المحفظة
- g. الدولة (مصدر البيانات: علاقات المستثمرين) - التصنيف الداخلي؛ يُستخدم في إعدادات المُحسّن وعرض تكوين المحفظة
- h. المنطقة أو منطقة الاستثمار (مصدر البيانات: علاقات المستثمرين) - تصنيف داخلي؛ يُستخدم في إعدادات المُحسّن وعرض تكوين المحفظة
- i. نوع السوق (متطور أو ناشئ) (مصدر البيانات: علاقات المستثمرين) - تصنيف داخلي؛ يُستخدم في إعدادات المُحسّن وعرض تكوين المحفظة

3.4 الأوراق المالية المتاحة

.يمكنك البحث عن أي أمان متاح بغض النظر عن إعداد الحساب أو المحفظة PoMaTo داخل

.للبحث عن ورقة مالية، اختر حقل "الأوراق المالية" من القائمة اليسرى. تعرض الصفحة الرئيسية قائمة كاملة بالأوراق المالية. يتيح شريط البحث البحث بالاسم أو أي مُعرّف

:يقوم التطبيق بإرجاع الأوراق المالية المطابقة مع المعلومات الرئيسية بما في ذلك

- a. اسم
- b. تم تحديد المعرف الأساسي للأمان
- c. دولة
- d. تداول العملات
- e. قطاع
- f. المنطقة (المنطقة)
- g. نوع السوق

سيؤدي النقر فوق صف الأمان إلى فتح جزء على الجانب الأيمن من الشاشة يعرض تفاصيل إضافية حول هذا الأمان، بما في ذلك لتحديده بشكل فريد PoMaTo جميع المعرفات المستخدمة داخل



4 المحفظة وإعداد الاستراتيجية

: لإنشاء محفظة جديدة، من الصفحة الأولى، انقر فوق زر إضافة محفظة جديدة

PoMaTo: the tool for all your investment needs

Strategy Search by code or name

You don't have any registered portfolios yet!

Add new portfolio

عند تحديد الزر، يتم فتح نافذة جديدة لتوجيه عملية إعداد المحفظة في ست خطوات.
ملاحظة: يجب إكمال كل خطوة من خطوات الإعداد الخمس وتأكيدتها بالضغط على زر التالي الموجود في أسفل يمين كل صفحة

Next

ملاحظة: بعد إكمال الخطوة الأخيرة، حدد زر إنشاء والالتزام الموجود في أعلى يمين الصفحة لإنشاء المحفظة وحفظها
إذا لم يتم تحديد هذا الزر، فلن يتم حفظ المحفظة. ستظهر عبارة "مسودة المحفظة" باللون الأحمر أعلى الصفحة، وستفقد جميع المعلومات المُدخلة عند تسجيل الخروج

Back Create and commit



4.1 الخطوة 1: المعلومات الأساسية

قم بملء جميع الحقول المطلوبة لقسم المعلومات الأساسية

تساعد هذه المعلومات في تحديد المحفظة الصحيحة أثناء عمليات تسجيل الدخول المستقبلية، خاصةً عندما تكون هناك محافظ متعددة مرتبطة بالحساب.

1. **الرمز** : رمز فريد مرتبط بالمحفظة الجديدة - يجب أن يتكون من 5 أحرف على الأقل
2. **الاسم** : اسم وصفي لرمز المحفظة (على سبيل المثال "صندوق كلية أليس" ولكن يمكن أن يكون أيضًا نفس الرمز)
3. **مُزَوِّد الرمز** : اختر مُزَوِّد المُعرِّف من القائمة المنسدلة. يُتيح خيار اختيار مُزَوِّد مُختلف لتحديد الأوراق المالية داخل المحفظة. سيتم استخدام المُزَوِّد المُختار في جميع **PoMaTo** علامات تبويب عرض المحفظة.
- a. ضمان دقة هذا المزود **PoMaTo**، ISINs
- b. يتم توفير معرفات بلومبرج أو رويترز على أساس "أفضل تطابق" على افتراض أنه يمكن استنتاجها من خلال رمز أداة التبادل المحلية
- c. **مُعرِّفات جوجل أو ياهو مُخصَّصة** بشكل أساسي للاستثمارات الفردية لتصفح الإنترنت فيما يتعلق بمنتجات المحفظة. من المُحتمل ألا تُقدِّم جوجل أو ياهو تغطيةً لسوقٍ مُعيَّنة، وفي هذه الحالة، سيتمُّ تعيين رمز مُشابه ("إعجاب") لا يرتبط بأيٍّ من المُزَوِّدين الآخرين
4. **العملة الأساسية** : اختر العملة الأساسية للمحفظة من القائمة المنسدلة. سيتم استخدام العملة المختارة في جميع علامات تبويب عرض المحفظة. بالنسبة للمستثمرين الأفراد، عادةً ما تكون العملة الأساسية هي عملة بلد الإقامة
5. **الاستراتيجية** : اختر استراتيجية المحفظة من القائمة المنسدلة. لا يمكن تغيير الاستراتيجية المحددة بعد اكتمال إعداد المحفظة.
6. مجموعة واسعة من مؤشرات الأداء لمراقبة **PoMaTo** مؤشر الأداء : اختر مؤشر الأداء من القائمة المنسدلة. يقدم الأداء النسبي. تشمل مؤشرات الأداء المتاحة مؤشرات فئة الأصول الفردية ومؤشرات فئات الأصول المتعددة، وقد بالإضافة إلى بورصات محلية مختلفة، S&P وBloomberg وMSCI باتباع منهجيات بناء مؤشرات **PoMaTo** طورته.
7. حدد المعيار الذي يجب فهرسة المحفظة وفقًا له، باستخدام القائمة المنسدلة. هذا الخيار متاح: **k معيار المؤشر** فقط عند اختيار استراتيجية الفهرسة المباشرة. الفهرسة المباشرة مدعومة لمحافظ الأسهم فقط، باستخدام معايير Eurostoxx50 بناءً على منهجيات مشابهة لمؤشر **PoMaTo** خاصة بكل بلد طورته.

بمجرد ملء جميع المعلومات المطلوبة، سيصبح زر التالي نشطًا

انقر فوق الزر "التالي" للمتابعة في إعدادات المحفظة



4.2 الخطوة 2: اختيار محفظة النموذج

يسمح قسم النموذج باختيار استخدام نموذج القيمة النسبية للأسهم أو عدم استخدامه ضمن تحسين المحفظة - وهذا قرار مهم والسبب المنطقي لهذا الاختيار موضح بالتفصيل في الشاشة أدناه.

يتم استخدام زر التبديل المنزلق لتنشيط نموذج الأسهم أو إلغاء تنشيطه.

بعد التحديد، حدد زر التالي للمتابعة في إعدادات المحفظة.

New Portfolio
Configure your portfolio

Draft Portfolio
Not Yet Created

Create and commit

1 Basic information

2 Model

3 Exchanges/Asset Class

4 Cash/Security

☒ Model

If you choose not to use the model, your optimization settings will not have access to parameters such as Alpha, Self Alpha, Dividend Yield, or the Relative Value Model.

However, if you decide to use the model within the PoMaTo application, you will be able to optimize your portfolio based on the algorithms.

1. The optimizer will utilize the Relative Value Model, which analyzes each security's balance sheet in comparison to its competitors at the sub-industry level. It also considers the surrounding macroeconomic environment to identify securities worth purchasing while avoiding those that are overvalued relative to their peers.
2. You will be able to optimize your portfolio based on an expected Dividend Yield calculated by the forecasting algorithms. These algorithms analyze long-term quarterly trends of balance sheet items and any seasonality that may be involved.
3. You will have the ability to optimize your portfolio using two types of Expected Returns calculated by the forecasting algorithms through multilinear regression on historical balance sheet data:
 - **Sector Alpha:** This is calculated by running a multilinear regression using the historical accounting and price data for all securities within each sub-industry.
 - **Self Alpha:** This is calculated by running a multilinear regression using the historical accounting and price data for each individual security.

Back

Next



4.3 الخطوة 3: اختيار البورصات/فئات الأصول

.سيقوم قسم البورصات/فئة الأصول بتحديد مجموعة فرعية من الأدوات المالية التي يمكن الاستثمار فيها في المحفظة .قم بتحديد المربعات ذات الصلة لتحديد البورصات وفئات الأصول المضمنة في محفظة الاستثمار والاستراتيجية المختارة يمكن إجراء الاختيارات على مستويات مختلفة - بشكل مستقل أو مجتمعة، مع مراعاة بعض القيود - اعتمادًا على متطلبات المحفظة.

1. مستوى فئة الأصول - انظر باللون الأزرق السهم في لقطة الشاشة

- عدالة
- الدخل الثابت
- سلعة
- الفوركس
- العملات المشفرة

2. نوع الأداة ضمن فئة الأصول - انظر باللون الأخضر السهم في لقطة الشاشة

- صناديق الاستثمار المتداولة
- الأدوات الفردية ضمن فئة الأصول

3. سهم واحد (حقوق الملكية) - انظر باللون الأرجواني الأسهم في لقطة الشاشة؛ يمكن تفصيل الاختيار الذي تم إجراؤه

- بشكل أكبر من أجل:
- المنطقة/المنطقة الجغرافية
- دولة
- التبادلات

.بعد إجراء التحديدات، حدد زر التالي للمتابعة في إعداد المحفظة



New Portfolio

Configure your portfolio

Draft Portfolio

Not Yet Created

Create and commit

1

Basic information

2

Model

3

Exchanges/Asset Class

4

Cash/Security

Max securities managed in subscription: 3000

Securities managed: 0

Asset Equity

Asset Fixed Income

Asset Commodity

Asset Forex

Asset Crypto

Asset Equity

Equity (31458)

ETF (1561)

Single Equity (29897)

Asia Pacific (17932)

Europe (5386)

Austria (57)

Belgium (111)

Czech Republic (23)

Denmark (141)

Estonia (20)

Finland (157)

France (561)

Germany (460)

XETR (391)

XFRA (68)

Boerse Frankfurt - Freiverkehr (FRAS) (0)

Boerse Frankfurt - Regulierter Markt (FRAA) (0)

Boerse Frankfurt - Scale (FRAS) (0)

Deutsche Boerse Ag (XFRA) (68)

XHAM (1)

Hungary (34)

Ireland (19)

Israel (422)

Italy (301)

Latvia (7)

Lithuania (23)

Luxembourg (0)

Netherlands (20)



4.4 الخطوة 4: المحفظة الحالية وإدخال النقد

4.4.1. استيراد المحفظة الحالية

. CSV يتيح قسم استيراد المحفظة استيراد محفظة موجودة، إما من خلال الإدخال اليدوي أو عن طريق استيراد ملف

New Portfolio
Configure your portfolio

Draft Portfolio
Not Yet Created

Create and commit

Basic information

Model

Exchanges/Asset Class

4
Cash/Security

Import Portfolio Csv

+ Cash

Search cash

+ Security

Search by security name

Cash

Quantity

Security

Quantity

USD

10,000.000

No records to display

Back

Create and commit



4.4.2. اليدوي للمحفظة الحالية

من خلال النقر على زر **+الأمان** ، من الممكن إضافة أي أوراق مالية ستكون متاحة بناءً على الاختيار الذي قمت به في الخطوة 3

فلن تكون الأوراق، **XNYS** → والولايات المتحدة → في أمريكا الشمالية → ملاحظة: إذا كان الاختيار في الخطوة 3 هو الأسهم **XNYS** مرئية أو قابلة للاختيار، حيث تم اختيار سوق (XNAS) المالية الفردية المتداولة في بورصة ناسداك .

بعد الضغط على زر **+الأمان** ، قم بملء الحقول ذات الصلة بما يلي

1. التاريخ - **أزرق** سهم
2. الأمان - يمكن البحث حسب الاسم أو المعرف الرئيسي (تم ضبطه في الخطوة 1) - **أخضر** سهم
3. الكمية المحتفظ بها على مستوى المحفظة - **برتقالي** سهم

ثم انقر فوق زر **التأكيد** لتأكيد الاستيراد - **أحمر** سهم



4.4.3 إدخال النقد

من الممكن إضافة أي خط نقدي موجود على مستوى المحفظة ، **+Cash** من خلال الضغط على زر

ملحوظة: خط النقد، في هذه الحالة، لا يعتبر أداة فوركس

في حالة أن يكون المركز النقدي عبارة عن استثمار في الفوركس، فسوف تحتاج إلى إضافة ذلك بالضغط على زر الأمان واختيار الزوج المناسب لمركز الفوركس

قم بملء الحقول ذات الصلة بما يلي ، **+Cash** بعد النقر على زر

1. التاريخ – **أزرق** سهم
2. للنقد الذي سيتم إضافته إلى المحفظة الأولية - **أخضر** سهم ISO العملة النقدية - رمز
3. الكمية المحتفظ بها على مستوى المحفظة - **برتقالي** سهم

ثم انقر فوق زر التأكيد لتأكيد الاستيراد - **أحمر** سهم



5 الفوركس مقابل العملات الأجنبية

PoMaTo ملخص حول التعامل مع العملات المتعددة وسوق الفوركس في

بشكل كامل المحافظ متعددة العملات، مما يُمكن كلاً من المحافظ والمحافظ من الاحتفاظ بخطوط نقدية PoMaTo يدعم متعددة، كل منها مُقوّم بعملة محددة. عادةً ما تكون الأرصدة النقدية المُحتفظ بها بعملة مختلفة عن العملة الأساسية للمحفظة ناتجة عن تداول الأسهم الأجنبية. في هذه الحالات، تُعتبر هذه الأرصدة نقدية تشغيلية (وليس أصولاً استثمارية)، وتُعرض كخطوط نقدية يُمكن إدارتها من خلال علامة التبويب التداول " (التبويب الفرعي "العملات الأجنبية"). على سبيل المثال، سيحتفظ مستثمر مقيم بالدولار الأمريكي ويتداول أسهمًا مُقوّم باليورو بخط نقدي باليورو لتسهيل تلك الصفقات.

ومع ذلك، وعلى الرغم من أن أرصدة النقد هذه لا تعتبر مراكز استثمارية، فإنها لا تزال تؤثر على القيمة الصافية اليومية للأصول والأداء الإجمالي للمحفظة بسبب تقلبات أسعار الصرف الأجنبي.

في هذه الحالة PoMaTo. عند ربط رصيد عملة باستراتيجية استثمار نشطة في سوق العملات الأجنبية، يُعامل كأصل فوركس في هو USD حيث USD_EUR يُمثل رصيد العملة مركز استثمار مُدروس، ويُصنف كأداة فوركس، ويُحدد بزواج العملات (مثل (هو عملة التسعير EUR العملة الأساسية و

FX مقابل FOREX في PoMaTo:

- إدارة النقد (النقد الأجنبي): تُدار الأموال النقدية المُحتفظ بها بعملات مختلفة لدعم أنشطة التداول فقط (وليس كاستثمار) كخطوط نقدية فردية للمزيد من التفاصيل، يُرجى مراجعة القسم 6.4 إدارة النقد - الأرصدة بعملة مختلفة عن العملة الأساسية للمحفظة.
- فوركس (مركز استثماري): إذا كان رصيد العملة جزءاً من استراتيجية استثمارية محددة في سوق العملات الأجنبية، فيجب إدخاله كأداة فوركس باستخدام صيغة زوج العملات المناسبة. لمزيد من التفاصيل، يُرجى مراجعة القسم 10.1.2. تداول الفوركس.



6 إدارة محفظة النقد

6.1 إدارة النقد

لإدارة الخطوط النقدية PoMaTo هناك عدة طرق يسمح بها

PoMaTo هذه الطرق ليست بديلة، ويجب استخدامها بحذر. مع أنها قد تبدو متشابهة، إلا أن كل طريقة تؤثر على كيفية تفسير لخط النقد، وبالتالي تؤثر على حسابات الأداء بشكل مختلف

: إليك القائمة العلوية لنشاط النقد

The screenshot shows the 'Cash Activity' tab in the PoMaTo interface. At the top, there are tabs for 'Info', 'Exchanges/Asset Class', 'Cash Activity' (selected), 'Portfolio', 'Optimization', and 'Trades'. An 'Advanced' button is on the right. Below the tabs, there's a section 'Enter a date range' with a calendar icon, a date range '16-09-2025 - 23-09-2025', and a close button 'X'. A red arrow points to the date range input. Below this, there are three tabs: 'Deposit/Withdraw' (selected), 'FX', and 'Cash'. Under 'Deposit/Withdraw', there are two buttons: 'Deposit' (with a down arrow) and 'Withdraw' (with an up arrow). To the right is a search bar 'Search by cash name'. Below these are columns for 'Date', 'Cash', and 'Quantity'. At the bottom, it says 'No records to display'.

6.2 إدارة النقد - الإيداع/السحب

تم تصميم وظيفة الإيداع/السحب لمحاكاة عمليات المكتب الخلفي وحركات النقد على مستوى الوسيط

لن يكون لإدارة النقد عن طريق الإيداع/السحب أي تأثير على الأداء

للوصول إلى وظيفة الإيداع/السحب، من القائمة العلوية انقر فوق القائمة النقدية ثم علامة التبويب الإيداع/السحب ثم انقر فوق زر الإيداع أو السحب

This screenshot is identical to the previous one, showing the 'Cash Activity' tab. However, a red arrow points to the 'Deposit/Withdraw' tab, which is already selected.



إملاً جميع الحقول في النافذة المنبثقة

1. التاريخ - للإيداع/السحب - بشكل افتراضي سيكون تاريخ اليوم
2. العملة النقدية - التي يتم بها الإيداع/السحب - ستكون افتراضياً عملة المحفظة
3. الكمية - من الإيداع/السحب

ثم انقر على زر التأكيد لتأكيد الإيداع/السحب

New Deposit

Date*
09-05-2025

Cash currency*
EUR

Quantity*
20,000

Cancel

Confirm

بمجرد التأكيد، سيظهر الإيداع/السحب في علامة التبويب الإيداع/السحب حيث من الممكن تنفيذ الإجراءات التالية على الإيداع/السحب:

1. عرض الكل - ضمن نطاق تاريخ محدد
2. يعدل
3. يمسح

Info Exchanges/Asset Class **Cash Activity** Portfolio Optimization Trades **Advanced**

Enter a date range
16-09-2025 – 23-09-2025

Deposit/Withdraw

FX

Cash

Deposit

Withdraw

Search by cash number

Date	Cash	Quantity	
23-09-2025	EUR	20,000.000	Deposit



6.3 إدارة النقد - كل شيء باستثناء الإيداع/السحب

للتعامل أيضًا مع جميع الأنشطة المتعلقة بالنقد (المشار إليها باسم النقد التجاري)، والتي تؤثر على PoMaTo تم تصميم أداء المحفظة

، يجب إدخال أنشطة نقدية أخرى يدويًا ، PoMaTo في حين تتم معالجة بعض الأنشطة، مثل الأرباح والقسائم، تلقائيًا بواسطة لأنها خاصة بكل محفظة وقد تختلف اعتمادًا على عوامل مثل الوسيط والحالة الضريبية وإعداد الحساب، وما إلى ذلك؛ Cash Action والمعروفة باسم

وسيتعرض إشعار في تاريخ الاستحقاق PoMaTo ملاحظة: سيتم معالجة الأرباح والقسائم المدفوعة تلقائيًا بواسطة

سوف تؤثر على الأداء Trade Cash إن إدارة النقد عبر

بشكل دقيق مع رسوم الوساطة وضريبة التداول وتكلفة بيانات السوق والفائدة المدفوعة على الرصيد PoMaTo لضمان تعامل النقدي أو أرباح الأسهم وقسائم الخصم المدفوعة (بسبب قيود مصادر البيانات)، يجب تقديم هذه المعلومات مباشرة إلى PoMaTo .

بالنسبة لحالات إدارة النقد المذكورة أعلاه، انقر فوق القائمة العلوية للنقد ثم انقر فوق علامة التبويب الفرعية للنقد اعتمادًا على إجراء النقد المطلوب تسجيله، على سبيل المثال CC- أو CC+ من علامة التبويب الفرعية النقدية ، انقر فوق الزر

- CC+ الأرباح المستلمة من مركز طويل، انقر فوق الزر
- CC- مدفوعات الضرائب، انقر فوق الزر

Date	Cash	Quantity	Type
23-09-2025	EUR	1,500.0000	INTEREST
23-09-2025	USD	2,000.0000	DIVIDEND

يمكن تسجيل عملية الدفع النقدي من خلال الخطوات التالية ، CC- أو CC+ من خلال الضغط على زر

1. النوع: اختر من الخيارات المتاحة في القائمة المنسدلة
2. التاريخ: تاريخ إجراء النقد (يتم تعيين التاريخ الافتراضي على اليوم)
3. العملة النقدية: من إجراء النقد
4. الكمية: التي سيتم معالجتها في المحفظة المتعلقة بنوع الإجراء تم اختياره أعلاه



انقر فوق زر التأكيد لتأكيد تسجيل النقد

New cash registration

Type*
FEES

Date*
09-05-2025

Cash currency*
EUR

Quantity*
10

Cancel Confirm

بمجرد التأكيد، سيظهر إجراء النقد على صفحة النقد حيث يكون من الممكن

1. عرض جميع إجراءات النقد ضمن نطاق تاريخ محدد
2. تعديل إجراء نقدي محدد
3. حذف إجراء نقدي محدد

Info Exchanges/Asset Class **Cash Activity** Portfolio Optimization Trades Advanced

Enter a date range
16-09-2025 – 23-09-2025

Deposit/Withdraw FX **Cash**

CC CC

Search by cash n

Date	Cash	Quantity	Type	
23-09-2025	EUR	1,500.0000	INTEREST	+
23-09-2025	USD	2,000.0000	DIVIDEND	+



6.4 إدارة النقد - الأرصدة بعملة مختلفة عن العملة الأساسية للمحفظة

محافظ العملات المتعددة، مما يسمح لكل من الحساب والمحافظ بتخزين خطوط نقدية متعددة - كل منها مقوم PoMaTo بعملة محددة.

لن يتم التعامل مع أرصدة النقد المحتفظ بها بعملة مختلفة عن العملة الأساسية للمحفظة كأصول استثمارية؛ بدلاً من ذلك يتم اعتبارها نقدًا.

ومع ذلك، فإن أرصدة النقد المحتفظ بها بعملة مختلفة عن العملة الأساسية للمحفظة سوف تؤثر على صافي القيمة اليومية للأصول والأداء الإجمالي للمحفظة بسبب التقلبات اليومية في أسعار الصرف الأجنبي - مثل تأثير الاحتفاظ بهذه الأرصدة كمركز استثماري في سوق الفوركس.

إذا كان رصيد العملة في الحساب مرتبطًا باستراتيجية استثمار في الفوركس (وبالتالي يمثل أحد الأصول)، فيجب تصنيفه كأداة فوركس، والتي يتم تمثيلها بواسطة زوج من العملات.

إن إدارة النقد في عدة عملات عبر "الفوركس" ستؤثر على الأداء بسبب الحركة اليومية لسعر الصرف

عندما يتم الاحتفاظ بأرصدة النقد بعملات مختلفة فقط لدعم نشاط تداول المحفظة، فيجب التعامل مع كل رصيد باعتباره **خط نقدي منفصل**.

على سبيل المثال، عادةً ما يحتفظ مستثمر مقيم بالدولار الأمريكي ويتداول أسهمًا مقومة باليورو بسيولة نقدية باليورو لدى وسيطه.

PoMaTo إذا كان هذا الرصيد باليورو مخصصًا للتداول فقط، فيجب اعتباره عملة أجنبية (وليس فوركس) وفقًا لتصنيف

مع أرصدة النقد الأجنبي هذه بشكل صحيح PoMaTo لضمان تعامل

1. انقر فوق علامة التبويب "النقد" من القائمة العلوية

2. FX ثم حدد علامة التبويب الفرعية

3. أدخل نشاط الفوركس ذي الصلة وفقًا لذلك

Date	Buy	Sell	Quantity	Price
25-07-2025	EUR Trade CCY: USD	USD Country: United States	2,000.0000	1.1700
25-07-2025	USD Country: United States	EUR Trade CCY: EUR	1,000.0000	0.8457
25-07-2025	USD Trade CCY: EUR	EUR Country: Europe	854.7000	0.8547



من علامة التبويب الفرعية "العملات الأجنبية"، انقر على زر "شراء" أو "بيع" حسب نوع معاملة العملات الأجنبية المراد . "تسجيلها". يُشار إلى ذلك بـ "صفقة العملات الأجنبية".

مثال : مستثمر مقيم في الاتحاد الأوروبي، وعملة محفظته الأساسية هي اليورو، يشتري أسهمًا من شركة آبل بقيمة 1000 دولار أمريكي. نتج عن ذلك رصيد نقدي بقيمة 1000 دولار أمريكي في حسابه متعدد العملات

. لتسوية هذا الرصيد السلبي، يحتاج المستثمر إلى شراء 1000 دولار أمريكي وبيع المبلغ المعادل له باليورو

:اختر أحد الخيارات التالية ،PoMaTo للقيام بذلك في

1. USDEUR – شراء

2. EURUSD – بيع

.لتحويل اليورو إلى الدولار الأمريكي للمبلغ المحدد PoMaTo في كلتا الحالتين، يتم توجيه

:عبر شراء ، أدخل ما يلي PoMaTo داخل FX إذا تم تنفيذ

- 1) USDEUR في مجال العملات الأجنبية
- 2) كمية الدولار الأمريكي التي يريد شراءها – 1000 في هذه الحالة
- 3) USD/EUR كان اليورو مطلوبًا لشراء 1 دولار أمريكي - وهذا هو سعر الصرف الشائع للزوج
- 4) الرسوم التي ستكون باليورو



Update Buy FX Trade

25-07-2025

FX*

USDEUR

Quantity USD to BUY*

1,000

Unit price EUR to BUY USD*

0.8457

Cost*

845.7

Fees in EUR*

2

Tot Cost*

847.7

Cancel

Confirm

عبر البيع ، أدخل ما يلي PoMaTo داخل FX إذا تم تنفيذ

- (1) EURUSD في مجال الفوركس
- (2) USDEUR كمية اليورو التي يريد بيعها – 1,000 * سعر الصرف
- (3) USD/EUR كان اليورو مطلوبًا لشراء 1 دولار أمريكي - وهذا هو سعر الصرف الشائع للزوج

الرسوم التي ستكون باليورو



Update Sell FX Trade

Date*

25-07-2025

FX*

EURUSD

Quantity EUR to SELL *

854.7

Unit price EUR to BUY USD*

0.8547

Cost*

854.7

Fees in EUR*

2

Tot Cost*

856.7

ملاحظات حول رسوم الصرف الأجنبي والعمللة الأساسية

- في جميع الأحوال، وبغض النظر عن كيفية إدخال معاملة الصرف الأجنبي، يتم التعبير عن الرسوم دائماً بالعمللة التي يتم بيعها أي العملة الأساسية في التجارة

يعني هذا أنه يجب إدخال الرسوم بالعمللة التي يتم استبدالها (أي بيعها) من أجل الحصول على عملة أخرى، PoMaTo في

على سبيل المثال، لنفترض أن مستثمراً مقيماً في الاتحاد الأوروبي، وعملة محفظته الأساسية هي اليورو، يبيع أسهماً في شركة آبل بقيمة 2000 دولار أمريكي. ينتج عن ذلك رصيد نقدي قدره 2000 دولار أمريكي في حسابه متعدد العملات

. لتحويل هذا المبلغ إلى اليورو مرة أخرى، من الضروري بيع 2000 دولار أمريكي

. (USDEUR) أو شراء (EURUSD) كما هو موضح سابقاً، يمكن القيام بذلك إما بمعاملة بيع في هذه الحالة، ولأن الدولار الأمريكي هو العملة المُباعة، فسيتم احتساب الرسوم بالدولار الأمريكي وليس اليورو



1. معاملة الشراء

يتيح (USD/EUR) النقر على زر "شراء" تحديد زوج العملات
كشراء دولار أمريكي وبيع يورو في آن واحد ، بناءً على سعر PoMaTo هذا تسجيل صفقة تداول العملات الأجنبية في
الصرف السائد وقت التداول

لإدخال هذه المعاملة بشكل صحيح

- أدخل تاريخ التداول
- USDEUR : أدخل زوج العملات
- أدخل كمية الدولار الأمريكي المشتراة
- أدخل مبلغ اليورو المطلوب لشراء 1 دولار أمريكي (أي سعر الصرف الأجنبي)
- أدخل أي رسوم باليورو تم دفعها للوسيط
- انقر فوق "تأكيد" لتسجيل المعاملة
- سيتم حساب الحقلين "التكلفة" و "التكلفة الإجمالية" تلقائيًا

2. معاملة البيع

يتيح EURUSD. النقر على زر "بيع" تحديد زوج العملات
كبيع لليورو وشراء متزامن للدولار الأمريكي ، بناءً على سعر PoMaTo ذلك تسجيل صفقة تداول العملات الأجنبية في
الصرف السائد وقت التداول

لإدخال هذه المعاملة بشكل صحيح

- أدخل تاريخ التداول
- EURUSD : ب. أدخل زوج العملات
- ج. أدخل كمية اليورو المباعة
- د. أدخل المبلغ بالدولار الأمريكي المستلم لكل يورو (أي سعر الصرف)
- هـ. أدخل أي رسوم بالدولار الأمريكي تم دفعها للوسيط
- و. انقر على "تأكيد" لتسجيل المعاملة
- سيتم حساب الحقلين "التكلفة" و "التكلفة الإجمالية" تلقائيًا

New Sell FX Trade

Date*

09-05-2025

FX*

EURUSD

Quantity EUR to SELL *

Unit price EUR to BUY USD*

Cost*

0

Fees*

0

Tot Cost*

0

Cancel

Confirm



:بمجرد التأكيد، ستظهر تجارة النقد الأجنبي ضمن علامة التبويب الفرعية للنقد الأجنبي ، حيث من الممكن

1. عرض جميع صفقات الفوركس ضمن نطاق تاريخ محدد

2. تعديل صفقة صرف العملات الأجنبية المحددة

3. محددة FX حذف صفقة



7 مراقبة المحفظة

يمكن أن تكون مراقبة المحفظة مهمة معقدة وتستغرق وقتًا طويلاً، وتتطلب حسابات معقدة وتجميع البيانات من مصادر متعددة.

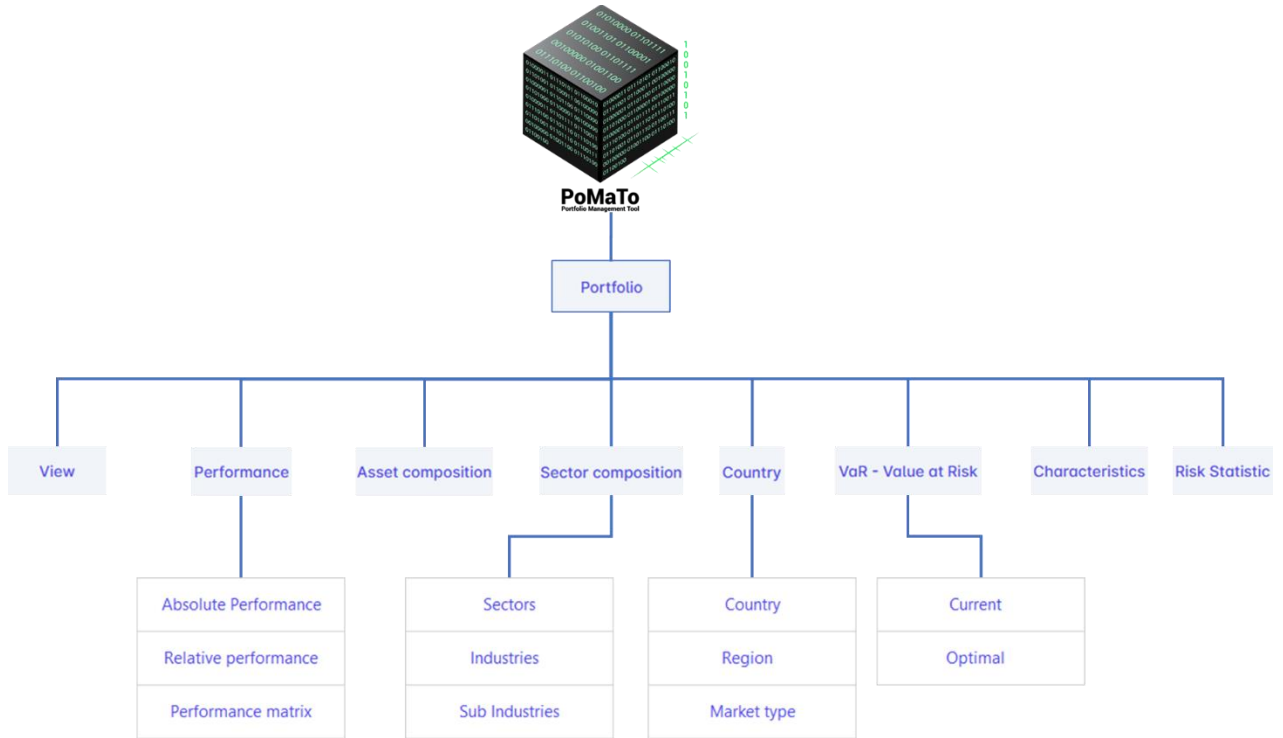
يتضمن مراقبة المحفظة مراجعة الأوراق المالية أو الأصول الفردية الموجودة داخل المحفظة بشكل منتظم، وتحليل العائدات وتقييم مستويات المخاطر، ومقارنة الأداء بالمعايير ذات الصلة.

يتيح الرصد الفعال تحديد فرص التحسين، ويدعم قرارات الشراء/البيع المستنيرة، ويضمن بقاء المحفظة متوافقة مع أهداف الاستثمار المحددة.

على تبسيط هذه العملية من خلال توفير جميع المعلومات الضرورية بنقرة واحدة على **PoMaTo**

علامة التبويب "المحفظة" ميزات مراقبة المحفظة

. يوضح الرسم البياني أدناه هيكل التنقل في القائمة لمراقبة أداء المحفظة عبر علامة التبويب المحفظة





:من خلال النقر على علامة التبويب **المحفظة** ، من الممكن التنقل عبر علامات التبويب الفرعية التالية

- منظر
- أداء
- تكوين الأصول
- تكوين القطاع
- دولة
- فار - القيمة المعرضة للخطر
- صفات
- إحصائيات المخاطر

تُقدم هذه التبويبات الفرعية رؤى حول كيفية توزيع المحفظة الاستثمارية على كل بُعد. تُساعد هذه الآراء في تقييم التنوع والتعرض الاستثماري حسب فئة الأصول، والقطاع الصناعي، والمنطقة الجغرافية، من خلال التعمق في التبويبات الفرعية التالية كلٌّ منها مُفصل في قسمه الخاص أدناه -

7.1 منظر

في علامة التبويب الفرعية "عرض"، يمكن مراقبة المحفظة من خلال تكوينها استنادًا إلى الأوراق المالية المحتفظ بها.

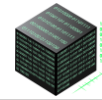
افتراضيًا تكوين المحفظة حتى تاريخه؛ ومع ذلك، يُمكن تحديد تاريخ مُحدد لعرض البيانات التاريخية. يُعرض كل أصل **PoMaTo** مُدرج في المحفظة افتراضيًا، ولكن يُمكن تخصيص تنسيق العرض

:المعلومات المعروضة في علامة التبويب الفرعية "عرض" لكل ورقة مالية محتفظ بها. انقر على اسم العمود لتغيير ترتيب الفرز

- الأمان: الاسم والمعرف (يتم اختياره كمعرف رئيسي أثناء الإعداد الأولي)
- القطاع : فئة الصناعة
- السوق: المتقدمة أو الناشئة
- المنطقة: المنطقة الجغرافية
- الدولة: الدولة التي يقع فيها المقر الرئيسي للشركة المصدرة أو المدرجة
- الأصول: فئة من الأدوات المالية
- النوع: تصنيف إضافي للأداة المالية
- الكمية: عدد الوحدات الموجودة في المحفظة
- الوزن: نسبة إجمالي قيمة المحفظة المخصصة لتلك الأوراق المالية المحددة

:يمكن تجميع المعلومات عن طريق تحديد حقل التجميع في مربع التجميع

- قطاع
- سوق
- منطقة
- دولة
- أصل



Info

Exchanges/Asset Class

Cash

Portfolio

Optimization

Trades

Advanced

View

Performance

Asset Composition

Sector Composition

Country

VaR

Characteristics

Risk Statistics

€1,390,287.95 (0.0002%)

25-07-2025

Aggregate and display by

Search by security name

Security	Sector	Market	Zone	Country	Asset	Type	Quantity	Weight %
<div> <div>Zinvest AG</div> <div>ZINV GY</div> </div>	Health Care	D	Europe	Germany	EQY	EQY	393	0.342
<div> <div>Adiax SA</div> <div>ALDUX FP</div> </div>	Communication Services	D	Europe	France	EQY	EQY	2,424	0.425
<div> <div>Aena SME SA</div> <div>AENA SQ</div> </div>	Industrials	D	Europe	Spain	EQY	EQY	1,010	1.648
<div> <div>Aeroporto Guglielmo Marconi di Bologna SPA</div> <div>ADIB IM</div> </div>	Industrials	D	Europe	Italy	EQY	EQY	5,242	3.167
<div> <div>Aib Group PLC</div> <div>AIBG ID</div> </div>	Financials	D	Europe	Ireland	EQY	EQY	312	0.156
<div> <div>Aixtron SE</div> <div>AIXA GY</div> </div>	Information Technology	D	Europe	Germany	EQY	EQY	550	0.632
<div> <div>Alma Media Oyj</div> <div>ALMA FH</div> </div>	Communication Services	D	Europe	Finland	EQY	EQY	919	0.856
<div> <div>Alqueria Quality SA</div> <div>ALQ SQ</div> </div>	Industrials	D	Europe	Spain	EQY	EQY	663	0.587
<div> <div>Alpari SCA</div> </div>	Financials	D	Europe	France	EQY	EQY	774	1.592

الضغط على خط أي أمان موجود في المحفظة سيفتح نافذة منبثقة توفر مراجعة مفصلة للأمان المحدد، بما في ذلك تحليل نتائج الإجراءات المتخذة حتى الآن.

ستعرض النافذة المنبثقة معلومات متعلقة بالأمان المحدد:

- "القسم العلوي: يعرض بيانات الوصف الأمني المتوفرة بالفعل في علامة التبويب الفرعية " عرض
- القسم السفلي: يعرض تفاصيل نشاط التداول المتعلق بالأوراق المالية، مع تحليل العائد الموضح بكل من عملة المحفظة والعملة المحلية، حيث
 - تشير عملة المحفظة إلى البيانات المحسوبة بناءً على العملة المحددة أثناء إعداد المحفظة الأولية
 - تشير العملة المحلية إلى البيانات المحسوبة بناءً على العملة التي تم تداول الأوراق المالية بها



<div> UniCredit SpA </div> <div>2025-05-12</div>		
Sector: Financials	Market: D	
Zone: Europe	Country: Italy	
Asset Class: EQY	Asset Type: EQY	
Quantity: 750	Weight: 5.064 %	
	Portfolio Currency	Local Currency
Currency	USD	EUR
Traded Price	56.78	52.44
Current Price	60.58	53.77
Var %	6.69	2.53
Book Cost	42,599.50	39,343.71
Book Value	45,436.99	40,327.50
Profit & Loss	2,837.50	983.79
P&L %	6.66	2.50

المعلومات التالية لكل الأوراق المالية الموجودة ضمن المحفظة **PoMaTo** بالنسبة لكل من المحفظة والعملية المحلية، يوفر

- العملة: عملة الأوراق المالية
- السعر المتداول: المتوسط المرجح لسعر تداول الأوراق المالية
- السعر الحالي: السعر بالعملة
- نسبة القيمة المعرضة للخطر: Var%
- تكلفة الكتاب: بما في ذلك أي رسوم وساطة مدفوعة
- القيمة الدفترية: التكلفة الأصلية لشراء الأمن
- الربح والخسارة: مبلغ الربح والخسارة، بما في ذلك أي رسوم وساطة مدفوعة
- نسبة الربح والخسارة: بما في ذلك أي رسوم وساطة مدفوعة

7.2 أداء

علامة التقييم الفرعية "الأداء" أداء المحفظة من خلال وجهات نظر إضافية، يمكن الوصول إليها عبر علامات التقييم الفرعية الأخرى المقابلة المفصلة أدناه:

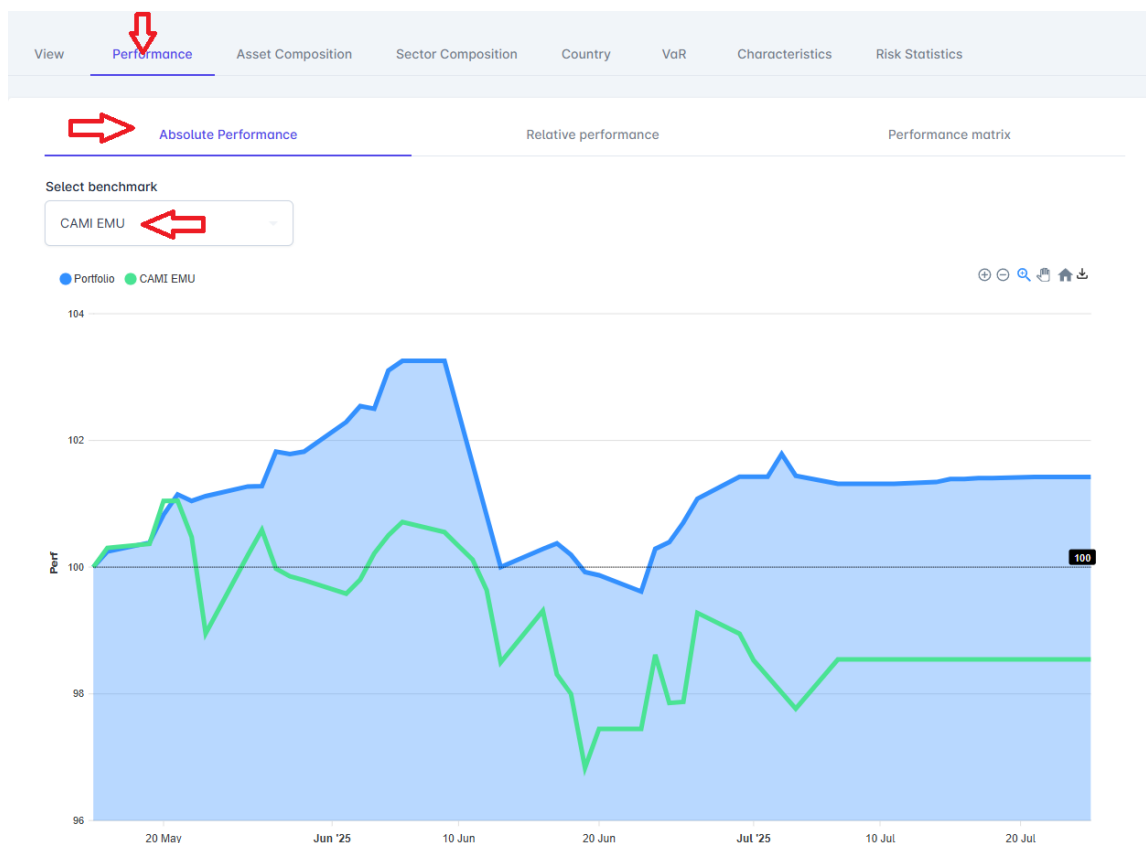
- الأداء المطلق
- الأداء النسبي
- مصفوفة الأداء



7.2.1 الأداء المطلق

ستعرض هذه علامة التبويب مخططًا لأداء المحفظة والمعيار المحدد، من حيث القيمة المطلقة، من خلال عرض الأداء (بقاعدة في تاريخ البدء) لكل من المحفظة والمعيار 100

بغض النظر عن المعيار المرجعي المحدد أثناء إعداد المحفظة الأولية، يمكن تغيير المعيار المرجعي في أي وقت



7.2.2 الأداء النسبي

يعرض هذا التبويب أداء محفظة الاستثمار مقارنةً بالمعيار المُختار من الإعدادات الأولى أو المعيار المُختار في تبويب "الأداء المطلق". يُمثل الرسم البياني، المُعدّ بقيمة أساسية 100 عند البداية، الفرق بين أداء المحفظة والمعيار المُختار



7.2.3 مصفوفة الأداء

ستعرض هذه علامة التبويب جدول مصفوفة الأداء الذي يمكن استخدامه لمراقبة أداء المحفظة والمعيار والأداء النشط عبر الأطر الزمنية المستخدمة بشكل شائع:

- يوميا: الأداء اليومي
- شهر حتى تاريخه: MTD
- الربع حتى تاريخه: QTD
- حتى تاريخه: YTD
- منذ البداية حتى الآن: ITD

View **Performance** Asset Composition Sector Composition Country VaR Characteristics Risk Statistics

Absolute Performance Relative performance **Performance matrix**

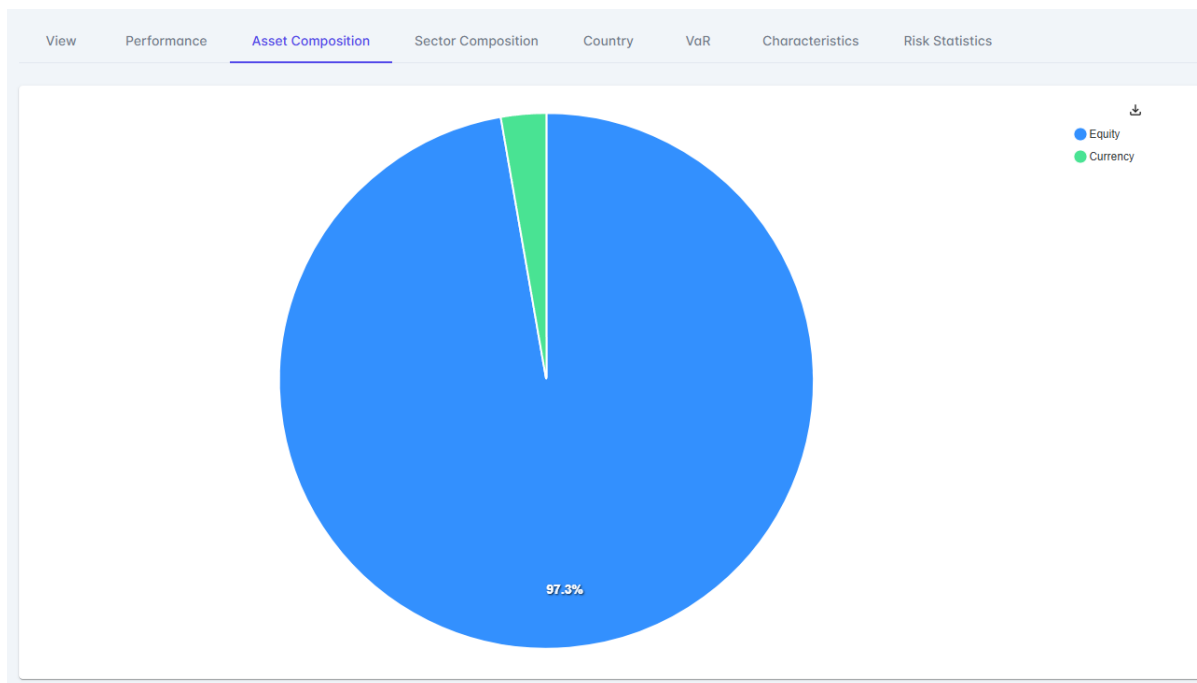
	USERGUIDELO	BENCHMARK	ACTIVE
DAILY	0	0	0
MTD	0	-0.41	0.41
QTD	0	-0.41	0.41
YTD	1.42	-1.46	2.88
ITD	1.42	-1.46	2.88



7.3 تكوين الأصول

ستعرض هذه علامة التبويب تعرض المحفظة لكل فئة من الأصول

إذا كان الرسم البياني يتضمن جزءًا دائريًا أصغر حجمًا يسمى "آخرون"، فإن النقر فوق هذا سيكشف عن تفصيل للمكونات الأساسية.



7.4 تكوين القطاع

علامة التبويب الفرعية "تكوين القطاع" تعرض المحفظة من خلال وجهات نظر إضافية، يمكن الوصول إليها عبر علامات التبويب الفرعية المقابلة المفصلة أدناه:

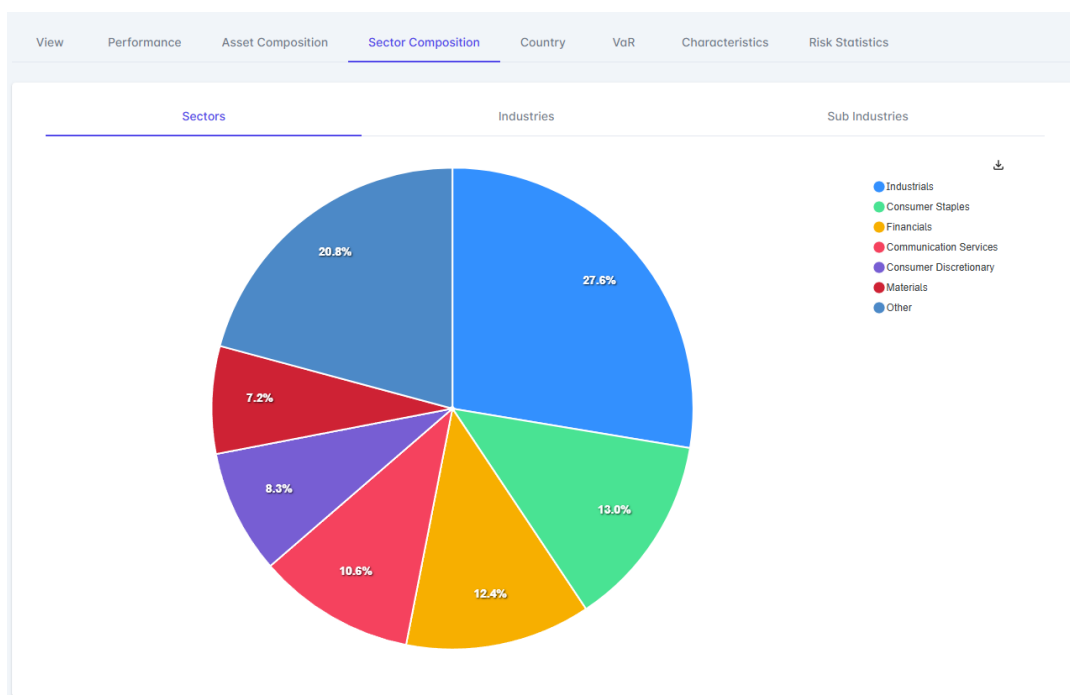
- القطاعات
- الصناعات
- الصناعات الفرعية

إذا كان أي مخطط يتضمن جزءًا دائريًا أصغر حجمًا يسمى "آخرون"، فإن النقر فوقه سيؤدي إلى الكشف عن تفصيل للمكونات الأساسية.



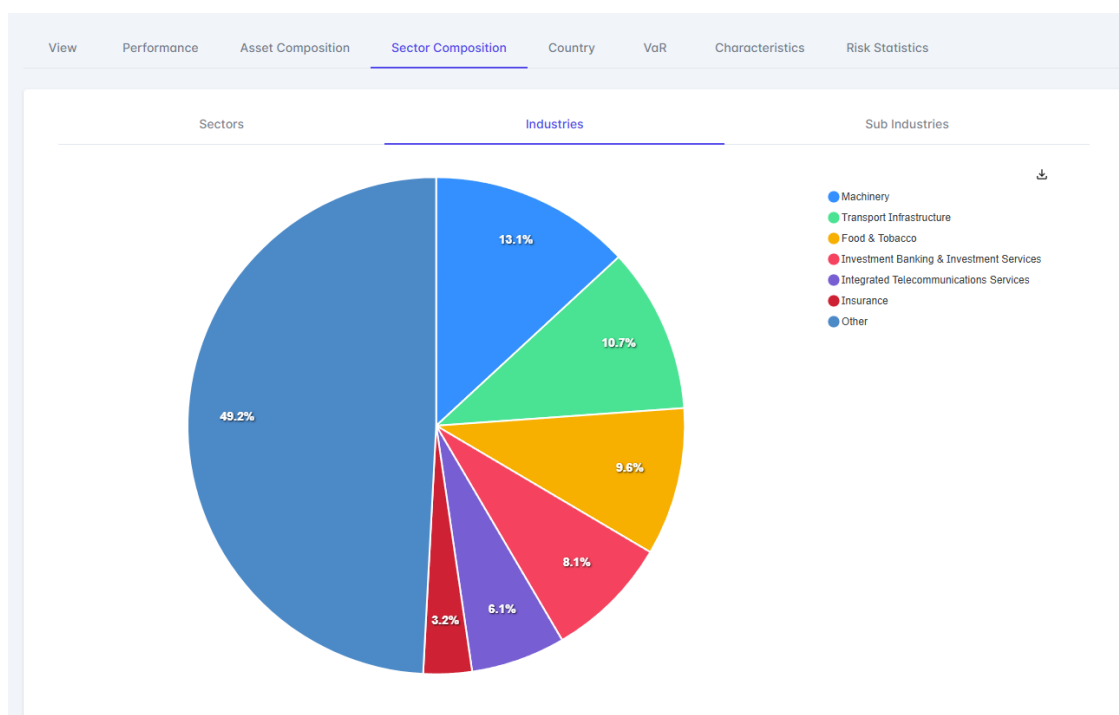
7.4.1 القطاعات

تُظهر علامة التبويب الفرعية الإضافية هذه تخصيص المحفظة عبر القطاعات رفيعة المستوى مثل التكنولوجيا أو الرعاية الصحية أو الخدمات المالية.



7.4.2 الصناعات

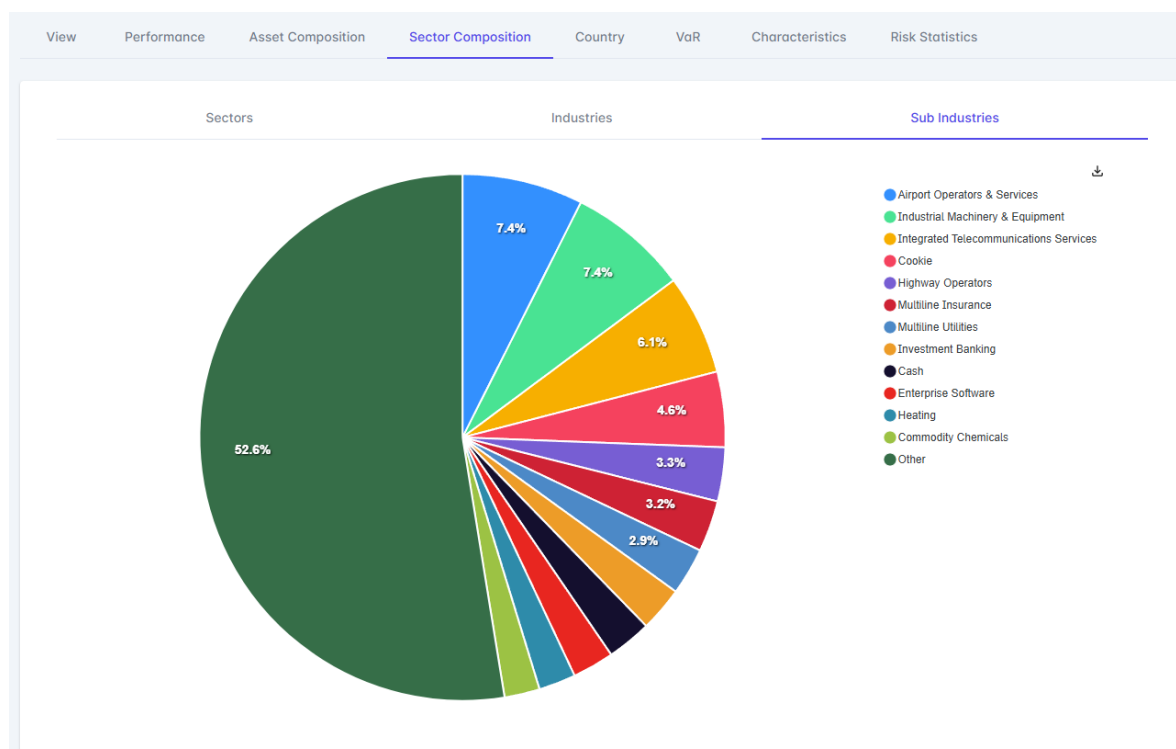
يقوم هذا التبويب الفرعي الإضافي بتقسيم التعرض القطاعي إلى صناعات محددة، مما يوفر رؤية أكثر تفصيلاً (على سبيل المثال (داخل التكنولوجيا: البرمجيات، وأشباه الموصلات، وما إلى ذلك).





7.4.3 الصناعات الفرعية

توفر علامة التبويب الفرعية الإضافية هذه عرضًا أكثر تفصيلاً من خلال تسليط الضوء على التعرض للصناعات الفرعية داخل كل صناعة (على سبيل المثال، برامج التطبيقات داخل البرامج).



7.5 دولة

علامة التبويب الفرعية "البلد" تعرض المحفظة من خلال وجهات نظر إضافية، يمكن الوصول إليها عبر علامات التبويب الفرعية المقابلة المفصلة أدناه:

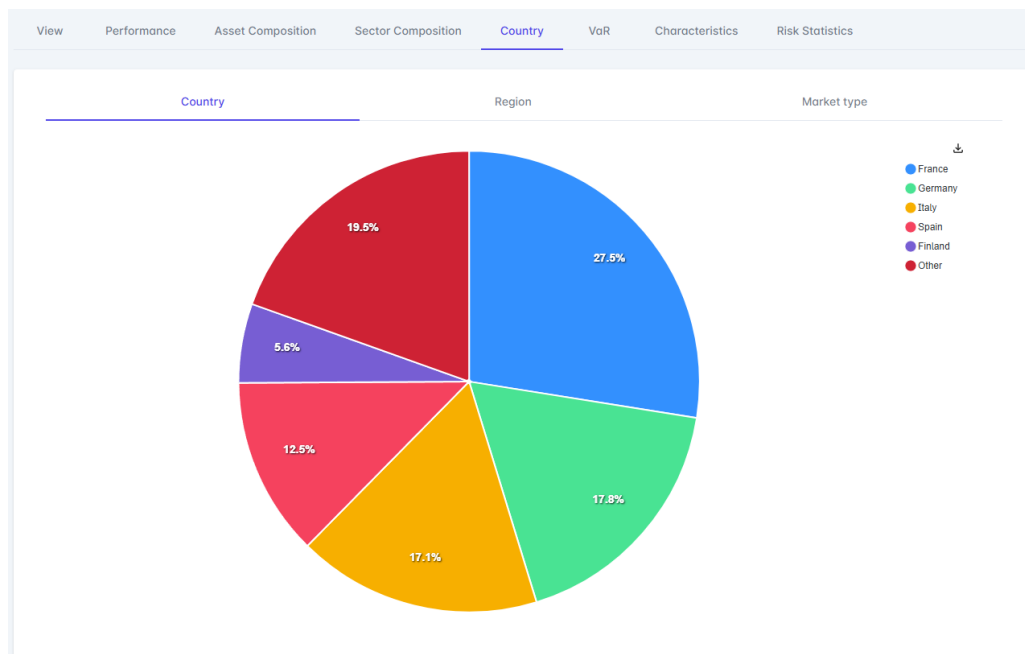
- دولة
- منطقة
- نوع السوق

إذا كان أي مخطط يتضمن جزءًا دائريًا أصغر حجمًا يسمى "آخرون"، فإن النقر فوقه سيؤدي إلى الكشف عن تفصيل للمكونات الأساسية.



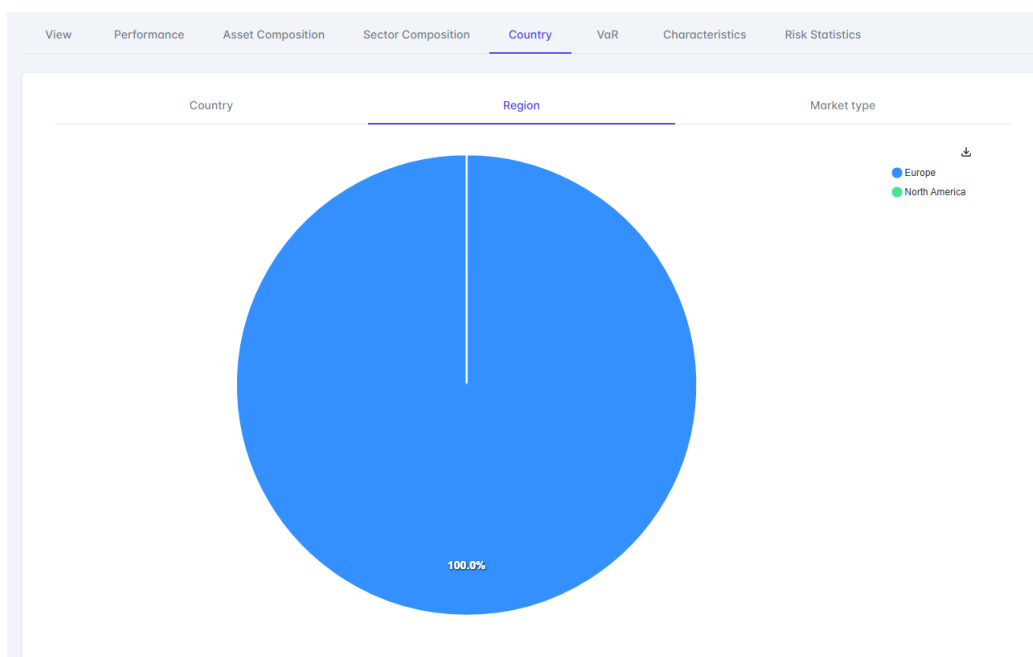
7.5.1 دولة

تعرض علامة التبويب الفرعية الإضافية هذه تخصيص المحفظة للدول الفردية، مع تسليط الضوء على التعرض الجغرافي المحدد.



7.5.2 منطقة

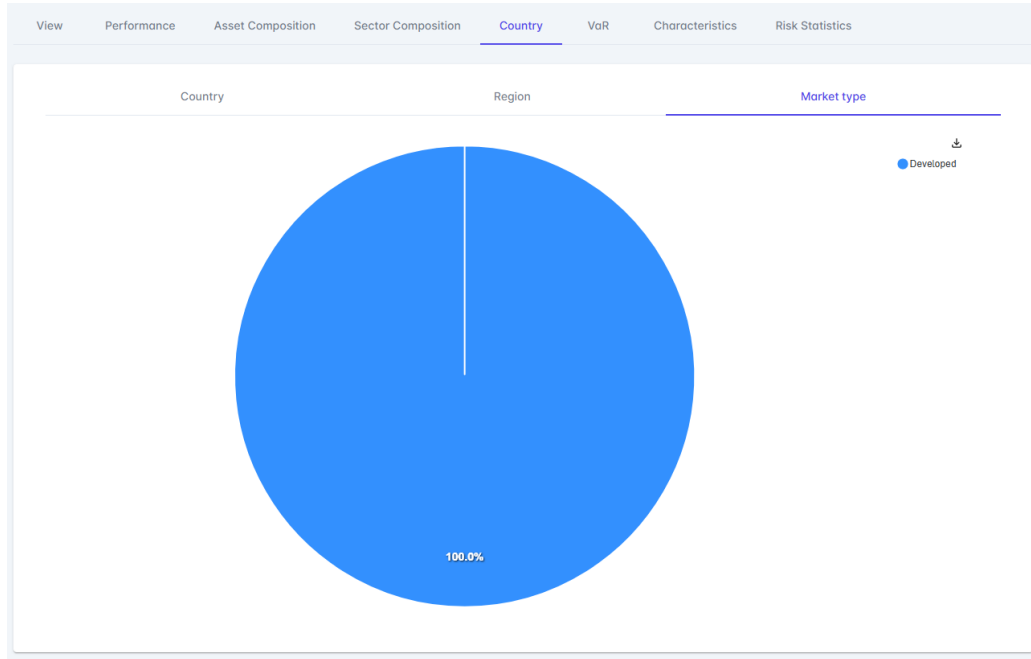
تجمع هذه علامة التبويب الفرعية الإضافية البلدان في مناطق أوسع (على سبيل المثال، أوروبا، وأمريكا الشمالية، وما إلى ذلك) مما يوفر رؤية عالية المستوى للتوزيع الإقليمي.





7.5.3 نوع السوق

تقوم علامة التبيويب الفرعية الإضافية هذه بتصنيف التعرض حسب فئات السوق مثل المتقدمة أو الناشئة لتقييم مخاطر المحفظة وملاحج التنويع.



7.6 (VaR) القيمة المعرضة للمخاطر

هو مقياس إحصائي يقيس الخسارة المالية المحتملة لمحفظة استثمارية خلال فترة زمنية محددة، مع مستوى معين من VaR الثقة.

ما يلي **PoMaTo** على عكس مقدمي الخدمة الآخرين، يتيح

- VaR اختر مستوى الثقة المرتبط بحسابات
- احسب مخاطر المحفظة في ظل ثلاثة سيناريوهات مختلفة لكل من المحفظة الحالية والمحسنة، إما كنسبة مئوية أو كقيمة مطلقة:

a. **عادي** : يفترض أن المحفظة تحمل مخاطر نموذجية للفترة التي تقع فيها تقلبات السوق ضمن نطاق البيانات المرصودة تاريخيًا

b. يفترض أن المحفظة تحمل مخاطر في فترة من التقلبات التاريخية في السوق أعلى من المعتاد : **T-Dist**

c. **كوشي** : يفترض أن المحفظة تحمل مخاطر خلال فترات الاضطرابات في السوق والنزوح الشديد

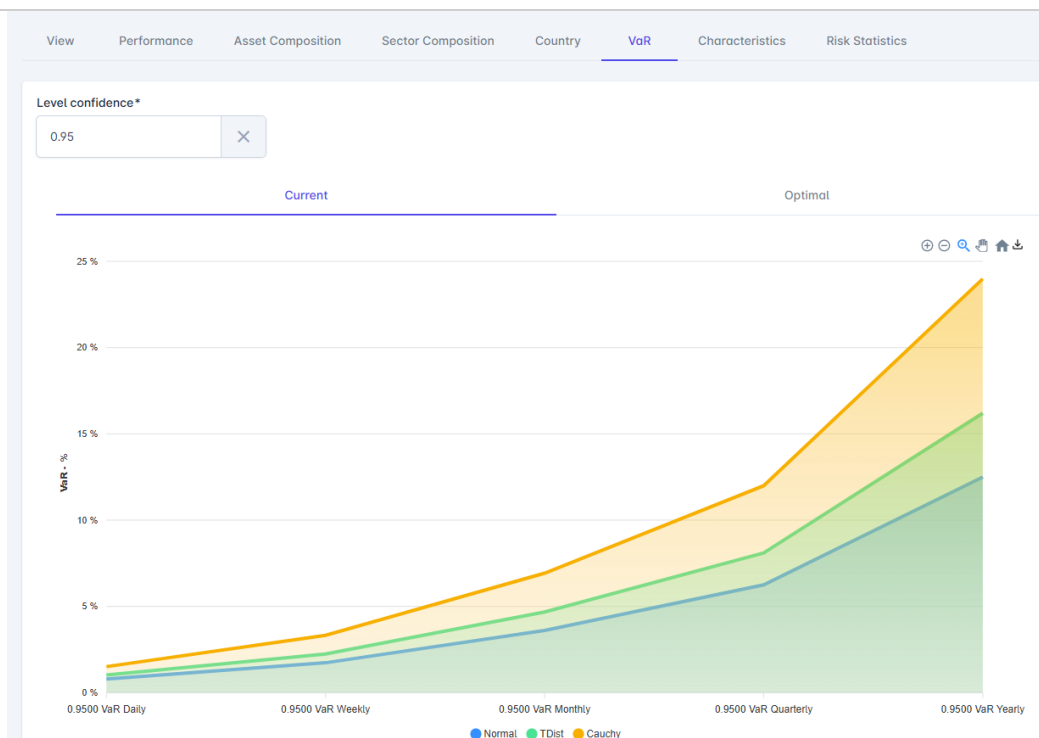
بوضوح من فهم المخاطر المرتبطة بالمحفظة، بالإضافة إلى الخسائر المحتملة في مختلف السيناريوهات والأطر **PoMaTo** رؤى حول كيفية تقليل المخاطر أو تخفيفها من خلال تطبيق المحفظة المحسنة **PoMaTo** الزمنية. كما يُقدم

تعرض علامة التبيويب الفرعية "القيمة المعرضة للخطر" قيمة المحفظة المعرضة للخطر من خلال وجهات نظر إضافية، يمكن الوصول إليها عبر علامات التبيويب الفرعية المقابلة المفصلة أدناه

- حاضر
- أفضل

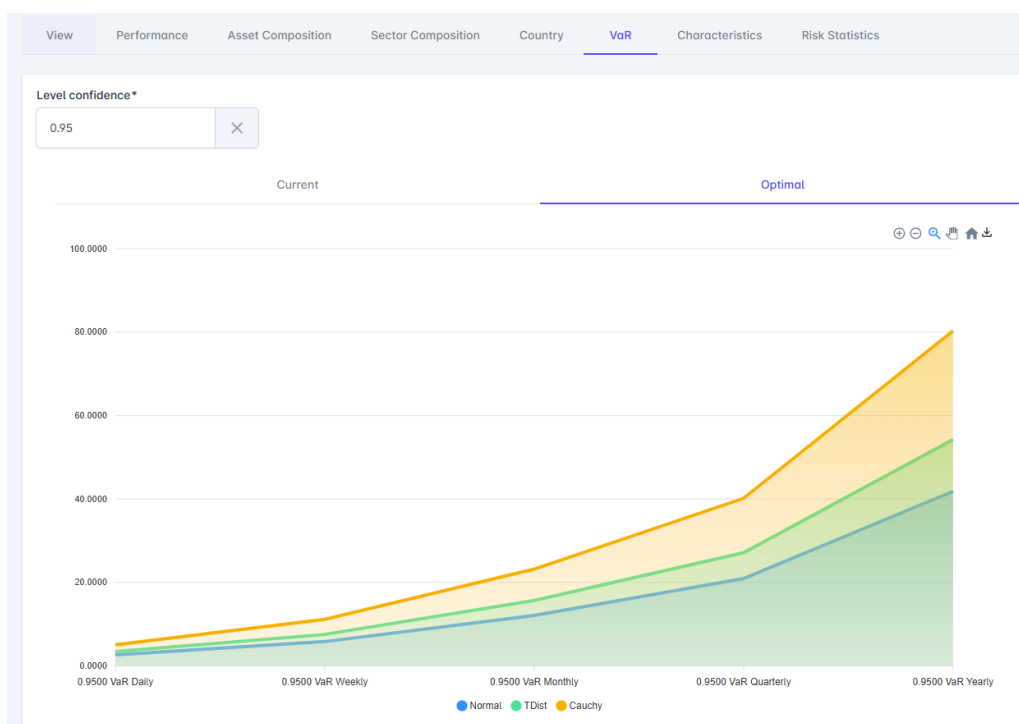
7.6.1 حاضر

تعرض علامة التبيويب الفرعية الإضافية هذه قيمة المخاطرة استنادًا إلى تكوين المحفظة الحالية، مما يعكس التعرض الحالي والمخاطر المرتبطة به.



7.6.2 أفضل

تُظهر علامة التبويب الفرعية الإضافية هذه قيمة المخاطرة لمحفظة الاستثمار المُحسَّنة وفقًا للنموذج، مما يتيح المقارنة بقيمة المخاطرة الحالية لتقييم إمكانية تقليل المخاطر أو الكفاءة.





7.7 صفات

فهمًا عميقًا للمحفظة المستثمرة في الأسهم PoMaTo

علامة التبويب الفرعية " الخصائص " لمحطة عامة عن المقاييس الأساسية الشائعة الاستخدام لمراقبة محفظة الأسهم. تُعرض هذه المقاييس الاثني عشر

السعر/القيمة الدفترية (3) نسبة السعر إلى القيمة الدفترية	السعر/الأرباح (2) نسبة السعر إلى الأرباح	السعر/المبيعات (1) نسبة السعر إلى المبيعات
الدفع (6) نسبة أرباح الشركة الموزعة على المساهمين في شكل أرباح	عائد الأرباح (5) نسبة قيمة المحفظة التي يتم إرجاعها للمستثمرين في شكل أرباح	القيمة السوقية الخماسية (4) التعرض لقيمة السوق
بيتا الأمثل على المدى الطويل (9) حساسية السوق على مدى فترة تاريخية أطول	بيتا الأمثل على المدى القصير (8) حساسية السوق خلال فترة قصيرة الأجل الأخيرة	قطاع ألفا (7) العائد الزائد الذي حققته المحفظة من قرارات تخصيص القطاعات
بيتا الحالية على المدى الطويل (12) بيتا الفعلية للمحفظة الحالية، على مدى فترة تاريخية أطول	بيتا الحالية قصيرة الأجل (11) بيتا الفعلية للمحفظة الحالية، على مدى فترة قصيرة الأجل حديثة	ألفا الذات (10) العائد الزائد المنسوب إلى الأوراق المالية الفعلية المختارة

: "يتم تمثيل هذه القيم في علامة التبويب الفرعية " الخصائص "

Performance	Asset composition	Sector composition	Country	VaR - Value at Risk	Characteristics	Risk Statistic
-4.32 Price/Sales	-37.41 Price/Earnings	-27.11 Price/Book Value				
-2.77 Quintile Market Cap	-4.97 % Dividend Yield	-88.48 % Pay Out				
6.60 % Sector Alpha	Optimal Beta Short Term	Optimal Beta Long Term				
7.26 % Self Alpha	-1.06 Current Beta Short Term	-1.16 Current Beta Long Term				



7.8 إحصائيات المخاطر

علامة التبويب الفرعية "إحصاءات المخاطر" مراقبة مقاييس المخاطر الشائعة الاستخدام المتعلقة بمحفظة الاستثمار. تُعرض هذه المقاييس الثمانية:

1) التقلبات المتوقعة للصندوق: الانحراف المعياري المتوقع للعوائد لمحفظة الاستثمار	2) التقلبات المحققة في الصندوق: الانحراف المعياري التاريخي الفعلي للعوائد
3) تقلبات المعيار: الانحراف المعياري للعوائد لمؤشر مرجعي	4) خطأ التتبع: تقلب الفرق بين عوائد المحفظة وعوائد مؤشرها المرجعي
5) الحد الأقصى للانخفاض: أكبر انخفاض من الذروة إلى القاع في قيمة المحفظة	6) الحد الأقصى للانخفاض بالأيام: أطول فترة (بالأيام) تستغرق للتعافي من أكبر انخفاض قبل الوصول إلى ارتفاع جديد
7) نسبة المعلومات: العائد المعدل للمخاطر لمحفظة الأوراق المالية بالنسبة لمعيارها المرجعي	8) نسبة شارب: العائد المعدل حسب المخاطر، والذي يتم حسابه عن طريق قسمة العائد الزائد للمحفظة على الانحراف المعياري

: "يتم تمثيل هذه القيم في علامة التبويب الفرعية "إحصائيات المخاطر"

Performance	Asset composition	Sector composition	Country	VaR - Value at Risk	Characteristics	Risk Statistic
55.49 % Fund Expected Volatility					31.98 % Fund Realized Volatility	
30.31 % Benchmark Volatility					48.66 % Tracking Error	
-15.58 % Max Drawdown					3.00 Max Drawdown in Days	
-1.36 Information Ratio					-1.97 Sharpe Ratio	



8 تحسين المحفظة

هو المنتج **PoMaTo . PoMaTo** يُعد تحسين المحفظة الاستثمارية عنصراً أساسياً في إدارة المحفظة، ويمثل الميزة المميزة لـ الوحيد الذي يوفر هذا المستوى من الإمكانيات ضمن منصة متكاملة وقابلة للتكوين بالكامل.

تحسين المحفظة الاستثمارية هو عملية بناء محفظة استثمارية تهدف إلى تعظيم العوائد مع تقليل المخاطر، بناءً على أهداف وإعدادات محددة ضمن برنامج التحسين. ويتحقق ذلك باختيار مزيج مثالي من الأصول يُتوقع أن يحقق أفضل عائد ممكن ضمن الحدود المحددة.

يُقلل التنوع بين فئات الأصول والقطاعات والمناطق من إجمالي مخاطر المحفظة. تستخدم عملية التحسين نماذج وخوارزميات رياضية لتحديد توزيع الأصول الأكثر فعالية، مع مراعاة العوائد المتوقعة، والتقلبات، وارتباطات الأصول. الهدف هو تعظيم العائد مع تقليل المخاطر بتطبيق قيود محددة، أو تقليل المخاطر لتحقيق عائد مستهدف، بناءً على متطلبات المحفظة.

المتطور، والذي يمكن تخصيصه بالكامل ليناسب أي هدف واستراتيجية Markowitz محسن متوسط التباين **PoMaTo** استثمارية.

من الممكن الاختيار من بين أربع خوارزميات تحسين خاصة، مما يتيح تنفيذ مجموعة **PoMaTo** باستخدام إعدادات مُحسَّن :واسعة من استراتيجيات الاستثمار

1. طويل فقط
2. طويل قصير (130/30)
3. محايد السوق
4. الفهرسة المباشرة

8.1 إعدادات التحسين

بالنقر فوق علامة التبويب "**التحسين**" ، يتم فتح صفحة الإعدادات الخاصة بالإستراتيجية/المحسن المحدد أثناء إعداد المحفظة الأولية.

من خلال هذه الصفحة، يمكن تكوين معلمات المحسن لتحقيق تكوين المحفظة المطلوب مع تقليل المخاطر.

تساعد قيود المعلمات في الحفاظ على التنوع من خلال منع التركيز المفرط في أي فئة استثمارية واحدة، وبالتالي تقليل تأثير الأحداث الخاصة بالفئة على الأداء الإجمالي للمحفظة.

تعتمد المعلمات المتاحة على الإستراتيجية/المحسن المختار - سيتم عرض حقول الإدخال ذات الصلة فقط.

في الأقسام التالية، سيتم تفصيل مربعات النص الخاصة بالمعلمات، وعند أي نقطة يتم عرضها - عند اختيار الاستراتيجية. يوضح كل عنوان لحقول الإدخال ما يلي:



مثال(أمثلة) في نص دليل المستخدم			قيمة
→ مستوى محفظة التطبيقات → مستوى أمان التطبيق			ملفّ حماية
			ما هو المستوى الذي ينطبق عليه المجال
الأسهم والدخل الثابت → فئة الأصول طويل فقط → مُحسّن			عدالة الدخل الثابت سلعة الفوركس العملات المشفرة
			ما هي فئات الأصول؟
[0,1] → الطويلة فقط → حقل للأعداد العشرية			عشري [0,1] [صافي القيمة, 0] إلخ
			ما هي قيمة إدخال الحقل المطلوبة
طويل فقط، طويل قصير → مُحسّن			طويل فقط طويل قصير محايد السوق الفهرسة المباشرة
			ما هي المحسّنات التي ينطبق عليها المجال

ضبط القيود في فئات القيود التالية PoMaTo تتيح لك مجموعة محسنات

1. قيود السوق والنقد
2. قيد النموذج
3. قيد المخاطر
4. قيد فئة الأصول
5. قيود القطاع
6. القيد الجغرافي
7. قيود البلد
8. قيد أمني واحد
9. قيد محدد للدخل الثابت
10. قيد مخصص

داخل كل قيد متاح في إعدادات الشريط الجانبي، هناك نوعان من القيود ، والتي يمكن تطبيقها إما على مستوى المحفظة أو على مستوى الأمان/المجموعة الفردية :



1. قيود مستوى المحفظة

يحدد هذا القيد حدودًا عبر المحفظة بأكملها

- (a) في علامة التبويب قيد المحفظة، يحدد قيد النقد رصيد النقد المطلوب الاحتفاظ به بعد تنفيذ كافة الصفقات.
- (b) في علامة التبويب "القيد الجغرافي"، يؤثر تطبيق قيد مستوى المحفظة على جميع المناطق بالتساوي، مما يؤدي إلى تعيين الحد الأدنى والحد الأقصى للأوزان للمحفظة بأكملها

2. قيود مستوى الأمان

يضع هذا القيد حدودًا لكل أمان فردي

- (a) على سبيل المثال: في علامة تبويب "قيد المحفظة"، يُحدد قيد الحد الأدنى لحجم التداول حدًا أقصى لحجم التداولات على كل ورقة مالية على حدة. إذا اقترح المُحسِّن تداولًا أقل من هذا الحد الأدنى، فسيتم استبعاده من التنفيذ.
- (b) في علامة التبويب "التقييد الجغرافي"، إذا تم تطبيق القيد على مستوى الأمان، فسوف ينطبق فقط على المنطقة المحددة التي تتعلق بها.

بعبارة أخرى:

تعمل القيود على مستوى المحفظة كقاعدة عامة عبر المحفظة بأكملها، في حين يتم تطبيق القيود على مستوى الأمان فقط على المعلمة المحددة أو مجموعة الأوراق المالية التي تتعلق بها (مثل أمان واحد أو جميع الأوراق المالية ضمن مجموعة معينة)

. يمكن العثور على هذه القيود في تنسيق قائمة الشريط الجانبي ضمن قائمة التحسين

ملحوظة:

- الحقول المعروضة متطابقة لكل من تكوينات السوق المحايدة والطويلة/القصيرة
- الحقول المعروضة متطابقة لكل من تكوينات الفهرسة الطويلة فقط والفهرسة المباشرة

Info Exchanges/Asset Class Cash Activity Portfolio **Optimization** Trades Advanced

Long Only Long Short Market Neutral Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings Results

Market and Cash Constraint

Portfolio Level

Cash* 0.01

Security Level

Min Trade Size in USD* 500

Market Type

Emerging min* 0 Emerging max* 0

Developed min* 0 Developed max* 1

Restore default Save

ملاحظة: يجب تأكيد أي تغييرات تُجرى ضمن أيٍّ من القيود المتاحة بالنقر على زر "حفظ" أسفل كل فئة قيد. في حال عدم حفظ التغييرات، ستُفقد المعلومات المُدخلة ولن يأخذها المُحسّن في الاعتبار.

التحقق من صحة إدخال المعلومات

في مربعات الإدخال، لكل معلمة، يوجد منطق التحقق من صحة إدخال البيانات، والذي يسمح فقط بإدخال القيم الصحيحة.

٪. يمكن إدخال أي قيمة بين ٠ و ١.٠ على سبيل المثال، قيمة ٠.٢٥، تعني ٢٥

هذه القيمة، المُعبّر عنها كعدد عشري، تُمثّل قيد المُعامل - سواءً كان الحد الأدنى أو الأقصى. تُدخّل هذه القيم في المُحسّن



8.1.1 قيود السوق والنقد

يمكن تعيين المعلومات التالية لقيود السوق والنقد ويتم تفصيلها في قسم خاص بها أدناه:

InfoExchanges/Asset ClassCash ActivityPortfolioOptimizationTradesAdvanced

Long OnlyLong ShortMarket NeutralIndexing

Optimize LONG ONLY

SettingsResults

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Portfolio Level

Cash*

0.01

Security Level

Min Trade Size in USD*

500

Market Type

Emerging min*

0

Emerging max*

1

Developed min*

0

Developed max*

1

Restore default

Save

- نقدي
- الحد الأدنى لحجم التداول
- الحد الأدنى والحد الأقصى الناشئ
- تم تطوير الحد الأدنى والحد الأقصى



Info
Exchanges/Asset Class
Cash Activity
Portfolio
Optimization
Trades
Advanced

Long Only
Long Short
Market Neutral
Indexing

Market and Cash Constraint
Model Constraint
Risk Constraint
Asset Class Constraint
Sector Constraint
Geographical Constraint
Country Constraint
Single Security Constraint
Fixed Income Specific Constraint
Custom Constraint

Portfolio Level
Cash*
0.01
Security Level
Min Trade Size in USD*
500
Market Type
Emerging min*
0
Emerging max*
0
Developed min*
0
Developed max*
1

Restore default
Save

8.1.1.1 نقدي

→ مستوى محفظة التطبيقات

الأسم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول

العشري [0,1] → الحقل

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسّن

يحدد قيد النقد الحد الأدنى لمبلغ النقد الذي ستحتفظ به المحفظة

يمكن إدخال أي قيمة بين ٠ و ١. تُمثل هذه القيمة، المُعبّر عنها كعدد عشري، الحد الأدنى للتخصيص النقدي

على سبيل المثال، يعني إدخال 0.01 أن المُحسّن سوف يُنشئ محفظة يكون فيها رصيد النقد بعد التداول 1% على الأقل

8.1.1.2 الحد الأدنى لحجم التداول

→ مستوى أمان التطبيق

الأسم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول

[0,NAV] عدد صحيح - المبلغ النقدي → حقل

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسّن

قيد الحد الأدنى لحجم التداول حدًا أدنى، من الناحية النقدية، لحجم التداول الأدنى المسموح به في معاملة واحدة

55 صفحة |



على سبيل المثال، إذا تم تعيين الحد الأدنى لحجم التداول على 5000 يورو، فسوف يستبعد المُحسّن أي صفقات أصغر من هذا المبلغ.

8.1.1.3 الحد الأدنى والحد الأقصى الناشئ

→ مستوى محفظة التطبيقات

الأسهم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول

العدد العشري [0,1] →، للفهرسة المباشرة الطويلة فقط → حقل

المحايد الطويل القصير [-1,1] → للسوق العشري → مجال

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسّن

تحدد معايير الأسواق الناشئة حدود تعرض المحفظة للأسواق الناشئة، بغض النظر عن المنطقة الجغرافية التي تتواجد فيها السوق الناشئة (أي، أمريكا اللاتينية [مثل البرازيل] مقابل منطقة آسيا والمحيط الهادئ [مثل الهند]).

تنطبق هذه المعلمة على المستوى الشامل، وتطبق على مستوى المحفظة من خلال تحديد النطاق الأدنى والأقصى للتعرض للأسواق الناشئة.

على سبيل المثال، يؤدي تعيين الحد الأدنى للأسواق الناشئة إلى 0.01 والحد الأقصى للأسواق الناشئة إلى 0.025 إلى إعطاء تعليمات للمُحسّن لإنشاء محفظة حيث يكون التعرض للأسواق الناشئة بين 1% و2.5% من إجمالي وزن المحفظة.

8.1.1.4 تم تطوير الحد الأدنى والحد الأقصى

→ مستوى محفظة التطبيقات

الأسهم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول

العدد العشري [0,1] →، للفهرسة المباشرة الطويلة فقط → حقل

المحايد الطويل القصير [-1,1] → للسوق العشري → مجال

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسّن

تحدد معايير الأسواق المتقدمة حدود تعرض المحفظة للأسواق المتقدمة، بغض النظر عن المنطقة الجغرافية التي تقع فيها السوق المتقدمة (أي أمريكا الشمالية [على سبيل المثال كندا] مقابل أوروبا [على سبيل المثال ألمانيا]).

تنطبق هذه المعلمة على المستوى الشامل، وتطبق على مستوى المحفظة من خلال تحديد النطاق الأدنى والأقصى للتعرض للأسواق المتقدمة.

على سبيل المثال، يؤدي تعيين الحد الأدنى للتطوير إلى 0.01 والحد الأقصى للتطوير إلى 0.025 إلى إعطاء تعليمات للمُحسّن لإنشاء محفظة يكون فيها التعرض للأسواق الناشئة بين 1% و2.5% من إجمالي وزن المحفظة.

8.1.2 قيود النموذج

لا يمكن تكوين قيود النموذج إلا إذا تم تمكين خيار تحديد النموذج أثناء إعداد المحفظة الأولية.

. تنطبق المعلومات المفصلة أدناه فقط على جزء الأسهم من المحفظة

تقديمها في قسم مخصص لها وسيتم عرض مدخلات المعلومات ذات الصلة فقط، اعتمادًا على الإستراتيجية المحددة.

- نقدي
- الحد الأدنى للقطاع ألفا
- أقصى قطاع ألفا
- الحد الأدنى من الذات ألفا
- ماكس سيلف ألفا
- الحد الأدنى لعائد الأرباح



• أقصى عائد للأرباح

فيما يلي مثال للشاشة الطويلة فقط

InfoExchanges/Asset ClassCash ActivityPortfolioOptimizationTradesAdvanced

Long OnlyLong ShortMarket NeutralIndexing

Optimize LONG ONLY

SettingsResults

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Model Constraint

Portfolio Level - Long Leg

Min Sector Alpha Required *0.03

Min Self Alpha Required *0.03

Min Dividend Yield Required *0.045

Restore defaultSave



فيما يلي مثال لشاشة السوق المحايدة/السوق القصيرة الطويلة

InfoExchanges/Asset ClassCash ActivityPortfolioOptimizationTradesAdvanced

Long OnlyLong ShortMarket NeutralIndexing

Optimize LONG SHORT

SettingsResults

Market and Cash Constraint
Model Constraint
Risk Constraint
Asset Class Constraint
Sector Constraint
Geographical Constraint
Country Constraint
Single Security Constraint
Fixed Income Specific Constraint
Custom Constraint

Model Constraint

Portfolio Level - Long Leg

Min Sector Alpha Required*

0.03

Min Self Alpha Required*

0.03

Min Dividend Yield Required*

0.055

Portfolio Level - Short Leg

Max Sector Alpha Required*

-0.03

Max Self Alpha Required*

-0.03

Max Dividend Yield Required*

0.015

Restore default

Save

8.1.2.1 الحد الأدنى للقطاع ألفا المطلوب

مستوى المحفظة → تطبيق

الأصول الأسهم → فئة

العشري [0,1] → الحقل

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسَّن

يحدد قيد ألفا القطاع الحد الأدنى للعائد المتوقع للمحفظة على أساس نموذج الأسهم ذات القيمة النسبية المبني على البيانات الأساسية.

يمكن إدخال أي قيمة بين ٠ و ١. تُمثل هذه القيمة، المُعبَّر عنها كعدد عشري، الحد الأدنى للعائد المتوقع للمحفظة، بناءً على المجموع المرجح لمعامل ألفا لكل ورقة مالية. يستخدم المُحسَّن هذا المُدخل لضمان أن معامل ألفا القطاعي للمحفظة يُلبى أو يتجاوز الحد المُحدَّد.



% على سبيل المثال، يؤدي إدخال قيمة 0.03 إلى توجيه المحسّن لإنشاء محفظة ذات ألفا قطاعية لا تقل عن 3

8.1.2.2 الحد الأقصى للقطاع ألفا المطلوب

→ مستوى محفظة التطبيقات

→ فئة الأصول

العشري [1,0] → الحقل

طويل قصير، محايد للسوق → مُحسّن

عندما يعمل المحسّن في تكوين طويل-قصير أو محايد للسوق، من الممكن تعيين أقصى ألفا قطاعي للساق القصيرة وأدنى ألفا قطاعي للساق الطويلة من المحفظة

، يمكن إدخال أي قيمة بين -1 و 0 للساق القصيرة. تُمثل هذه القيمة، المُعبّر عنها كعدد عشري، أقصى عائد متوقع للساق القصيرة محسوبًا بمجموع حاصل ضرب أوزان الأوراق المالية وقيم ألفا المقابلة لها

على سبيل المثال، يؤدي تعيين القيمة إلى -0.03 إلى إعطاء تعليمات للمُحسّن بإنشاء محفظة حيث يكون قطاع ألفا للساق القصيرة أقل من أو يساوي -3

8.1.2.3 الحد الأدنى المطلوب من ألفا الذاتي

→ مستوى المحفظة

→ فئة الأصول

العشري [0,1] → الحقل

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسّن

يُحدد قيد الحد الأدنى لمعامل ألفا الذاتي الحد الأدنى للعائد المتوقع للمحفظة الاستثمارية بناءً على التباين بين العوائد التاريخية الملاحظة وتلك المُتوقعة من خلال نموذج الانحدار. يعكس هذا التباين، المعروف أيضًا باسم الخطأ المتبقي، جزءًا من تباين العائد الذي لا يُفسره الانحدار

يمكن إدخال أي قيمة بين 0 و 1. تُمثل هذه القيمة، المُعبّر عنها كعدد عشري، الحد الأدنى للعائد المتوقع للمحفظة، ويُحسب بجمع أوزان الأوراق المالية وقيم ألفا الذاتية الخاصة بها

الذاتي 5% على الأقل Alpha على سبيل المثال، يؤدي تعيين قيمة 0.05 إلى إعطاء تعليمات للمُحسّن بإنشاء محفظة حيث يكون

8.1.2.4 الحد الأقصى للألفا الذاتي المطلوب

→ مستوى محفظة التطبيقات

→ فئة الأصول

العشري [1,0] → الحقل

طويل قصير، محايد للسوق → مُحسّن

الذاتي للساق القصيرة من Alpha عندما يعمل المحسّن في تكوين طويل قصير أو محايد للسوق، يمكن تعيين قيد الحد الأقصى لـ الذاتي على الساق الطويلة Alpha المحفظة، بينما ينطبق قيد الحد الأدنى لـ

يمكن إدخال أي قيمة بين -1 و 0. تُمثل هذه القيمة، المُعبّر عنها كعدد عشري، أقصى عائد متوقع للساق القصيرة للمحفظة، بناءً على المجموع المرجح لمعامل ألفا لكل ورقة مالية. يستخدم المُحسّن هذا المُدخل لضمان عدم تجاوز معامل ألفا الذاتي للساق القصيرة الحد المُحدّد

على سبيل المثال، يؤدي إدخال قيمة -0.05 إلى توجيه المُحسّن لإنشاء محفظة حيث تكون قيمة ألفا الذاتية للساق القصيرة أقل من أو تساوي -5



8.1.2.5 الحد الأدنى لعائد الأرباح المطلوب

→ مستوى محفظة التطبيقات

الأسهم → فئة الأصول

العشري [0,1] → الحقل

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسّن

يحدد قيد عائد الأرباح الحد الأدنى المتوقع لعائد الأرباح للمحفظة، استنادًا إلى مخرجات نموذج الأسهم ذات القيمة النسبية يمكن إدخال أي قيمة بين ٠ و ١، لتمثيل الحد الأدنى المطلوب لعائد أرباح المحفظة في صورة عدد عشري. يُحسب هذا بجمع أوزان المحفظة وعوائد أرباح الأوراق المالية المختارة

% على سبيل المثال، يؤدي إدخال قيمة 0.045 إلى تكليف المُحسّن بإنشاء محفظة ذات عائد أرباح متوقع لا يقل عن 4.5

8.1.2.6 الحد الأقصى لعائد الأرباح المطلوب

→ مستوى محفظة التطبيقات

الأسهم → فئة الأصول

العشري [0,1] → الحقل

طويل قصير، محايد للسوق → مُحسّن

عند التداول في وضعية "طويل-قصير" أو "محايد السوق"، يُمكن تطبيق قيد أقصى لعائد الأرباح على الضلع القصير من المحفظة. يُحدد هذا الحد الأقصى لعائد الأرباح المتوقع من المراكز القصيرة

يمكن إدخال أي قيمة بين ٠ و ١، لتمثيل أقصى عائد توزيعات أرباح مسموح به في صورة عدد عشري. يُحسب هذا العائد بجمع أوزان الضلع القصير وعوائد توزيعات الأرباح الفردية للأوراق المالية في الضلع القصير

على سبيل المثال، يؤدي إدخال قيمة 0.015 إلى توجيه المُحسّن لإنشاء محفظة حيث يكون العائد على أرباح الساق القصيرة أقل % من أو يساوي 1.5

8.1.3 قيد المخاطر

يمكن تعيين المعلمات التالية لقيود المخاطر ويتم تفصيلها في قسم خاص بها أدناه

- بيتا (إدخالات مختلفة)
- محفظة الحد الأقصى لقيمة السوق (طويلة الأجل)
- محفظة الحد الأدنى لقيمة السوق الخماسية (قصيرة)
- حجم القيمة السوقية (إدخالات مختلفة)
- أقصى مشاركة في السوق



InfoExchanges/Asset ClassCash ActivityPortfolioOptimizationTrades

Advanced

Long OnlyLong ShortMarket NeutralIndexing

Optimize LONG ONLY

SettingsResults

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Risk Constraint

Portfolio Level

Min Long Term Beta Required*

0.95

Max Long Term Beta Required*

1.05

Min Short Term Beta Required*

0.95

Max Short Term Beta Required*

1.05

Max Quintile Market Cap Portfolio (Long)*

2.75

Max Market Participation*

0.25

i

Capitalization Buckets

Min Mega Cap*

0

Max Mega Cap*

1

Min Large Cap*

0

Max Large Cap*

1

Min Mid Cap*

0

Max Mid Cap*

1

Min Small Cap*

0

Max Small Cap*

1

Min Micro Cap*

0

Max Micro Cap*

1

Restore default

Save



8.1.3.1 بيتا (إدخالات مختلفة)

→ مستوى محفظة التطبيقات

الأسهم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول

العشري [-2،+2] → الحقل

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسّن

بيتا المحفظة هي مقياس لحساسية المحفظة لتقلبات السوق مقارنةً بمؤشر مرجعي. تشير بيتا 1 إلى أن عوائد المحفظة تتوافق مع المؤشر المرجعي، بينما تشير بيتا أكبر من 1 إلى أن المحفظة أكثر تقلبًا من السوق، بينما تشير بيتا أقل من 1 إلى أن المحفظة أقل تقلبًا من السوق.

من الممكن ضبط إعداد لكل من الحد الأدنى والحد الأقصى لبيتا، مما يقيد حساسية المحفظة لحركات السوق ضمن نطاق محدد.

يمكن تطبيق قيود بيتا لتعكس سلوك المحفظة على المدى الطويل والقصير بالنسبة للسوق.

- الحد الأدنى المطلوب للإصدار التجريبي طويل المدى
- الحد الأقصى للإصدار التجريبي طويل الأمد المطلوب
- الحد الأدنى المطلوب للإصدار التجريبي قصير المدى
- الحد الأقصى للإصدار التجريبي القصير الأجل المطلوب

8.1.3.2 محفظة الحد الأقصى لقيمة السوق (طويلة الأجل)

→ مستوى محفظة التطبيقات

الأسهم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول

العشري [1،5] → الحقل

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسّن

من الممكن تعيين كل الأوراق المالية المتاحة إلى دلو القيمة السوقية

يوجد إجمالي خمسة دلاء، يمثل كل منها إحدى الفئات التالية:

- الخماسي الأول، هي الأوراق المالية ذات القيمة السوقية الضخمة
- الخماسي الثاني، هي الأوراق المالية ذات القيمة السوقية الكبيرة
- الخماسي الثالث، هي الأوراق المالية ذات القيمة السوقية المتوسطة
- الخماسي الرابع، هي الأوراق المالية ذات القيمة السوقية الصغيرة
- الخماسي الخامس، هي الأوراق المالية ذات القيمة السوقية الصغيرة

يمكن تطبيق حد أقصى لخمس أسهم من القيمة السوقية على مستوى المحفظة

على سبيل المثال، يؤدي تعيين خمس أقصى عند 3 على مستوى المحفظة إلى السماح للمُحسّن بتضمين الأوراق المالية من خمس أعلى (على سبيل المثال، الخمس 5) من مستوى الأمان، بشرط ألا يتجاوز المتوسط المرجح للممتلكات الموصى بها 3

بعبارة أخرى، تحدد قيمة القيد المحددة (التي تتراوح من 1 إلى 5) كيفية وضع المحفظة أو الاستراتيجية فيما يتعلق بمتوسط القيمة السوقية.

8.1.3.3 الحد الأدنى لقيمة السوق الخماسية (قصيرة)

→ مستوى محفظة التطبيقات

الأسهم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول



العشري [1,5] → الحقل

طويل قصير، محايد للسوق → مُحسَّن

عندما يعمل المحسَّن في تكوين طويل-قصير أو محايد للسوق، من الممكن تعيين حد أدنى لخمسة أجزاء للساق القصيرة وحد أقصى لخمسة أجزاء للساق الطويلة من المحفظة

على سبيل المثال، فإن تحديد الحد الأدنى للخمسة عند 2 يعني أن المتوسط المرجح للأوراق المالية في الساق القصيرة - بناءً على أوزانها وخماسيات القيمة السوقية - يجب أن يكون مساوياً أو أكبر من 2. وينطبق هنا نفس المنطق المستخدم لقيود الحد الأقصى للخمسة على الساق الطويلة: لا يزال من الممكن تضمين الأوراق المالية الفردية خارج النطاق المحدد، طالما تم احترام القيد المرجح الإجمالي.

8.1.3.4 أقصى مشاركة في السوق

→ مستوى أمان التطبيق

الأسهم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول

العشري [0,1] → الحقل

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسَّن

يرتبط قيد المشاركة في السوق بمتوسط حجم التداول اليومي لكل ورقة مالية فردية

يمكن إدخال أي قيمة أكبر من 0. تُمثل هذه القيمة، المُعبر عنها كعدد عشري، الحد الأقصى لمتوسط حجم التداول اليومي للأوراق المالية الذي يُمكن تداوله عند بناء مركز المحفظة

على سبيل المثال، تعني قيمة 0.25 أن المُحسَّن سيُقيّد بشراء ما لا يزيد عن 25% من متوسط حجم التداول اليومي لأي ورقة مالية مُحددة. ويمكن تفسير ذلك على أنه الحد الأقصى المقبول لاستهلاك السيولة

8.1.3.5 حجم القيمة السوقية (إدخالات مختلفة)

→ مستوى أمان التطبيق

الأسهم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول

[0,1] → الطويلة فقط → حقل للأعداد العشرية

المحايد الطويل القصير [-1,1] → للسوق العشري → مجال

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق → مُحسَّن

إلى جانب الحد الأقصى لخمسة القيمة السوقية، والذي ينطبق على مستوى المحفظة، من الممكن أيضاً تعيين الحد الأدنى والحد الأقصى للأوزان التي يمكن أن تحملها المحفظة ضمن كل دلو من القيمة السوقية من خلال تكوين الحقول التالية:

- الحد الأدنى للقيمة القصوى
- ماكس ميجا كاب
- الحد الأدنى لرأس المال الكبير
- الحد الأقصى للغطاء الكبير
- الحد الأدنى لرأس المال المتوسط
- الحد الأقصى للقيمة المتوسطة
- الحد الأدنى لرأس المال الصغير
- الحد الأقصى للقيمة السوقية الصغيرة
- الحد الأدنى للقيمة الصغرى
- ماكس مايكرو كاب



2.75	0.25	i
------	------	---

Capitalization Buckets

Min Mega Cap*	Max Mega Cap*
<input type="text" value="0"/>	<input type="text" value="1"/>
Min Large Cap*	Max Large Cap*
<input type="text" value="0"/>	<input type="text" value="1"/>
Min Mid Cap*	Max Mid Cap*
<input type="text" value="0"/>	<input type="text" value="1"/>
Min Small Cap*	Max Small Cap*
<input type="text" value="0"/>	<input type="text" value="1"/>
Min Micro Cap*	Max Micro Cap*
<input type="text" value="0"/>	<input type="text" value="1"/>

[Restore default](#)[Save](#)

تمثل القيمة المدخلة، بالأرقام العشرية، الحد الأدنى والحد الأقصى للوزن الذي ستحمله المحفظة لكل دلو من القيمة السوقية

إلى 0.05 والحد الأقصى إلى 0.1 إلى توجيه المُحسَّن لإرجاع Mega Cap على سبيل المثال، يؤدي تعيين الحد الأدنى لدلو % على الأقل ولكن أقل من أو يساوي 10 % Mega Cap محفظة حيث يكون الوزن الإجمالي للأوراق المالية في فئة



8.1.4 قيود فئة الأصول

تعمل معلمات فئة الأصول على تحديد حدود تعرض المحفظة لفئات أصول محددة.

→ مستوى محفظة التطبيقات

الأسهم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول

للأعداد العشرية $[0,1]$ → طويل فقط، فهرسة مباشرة → مربع نص

$[-1,1]$ → للسوق المحايد العشري → مربع نص

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسّن

يمكن تعيين المعلمات التالية لكل فئة من الأصول ويتم تفصيلها في قسم خاص بها أدناه

- نطاق شامل ينطبق على جميع فئات الأصول
- نطاق الحد الأدنى والحد الأقصى المحدد لكل فئة من الأصول

Info

Exchanges/Asset Class

Cash Activity

Portfolio

Optimization

Trades

Advanced

Long Only

Long Short

Market Neutral

Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings

Results

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Asset Class Constraint

Portfolio Level

Min Asset Weight*

0

Max Asset Weight*

1

Single Asset Class Level

Search by asset name

ASSET	MIN	MAX		
Commodity	0.00000	1.00000		
Cryptocurrency	0.00000	1.00000		
Equity	0.00000	1.00000		
Fixed Income	0.00000	1.00000		
Forex	0.00000	1.00000		

Restore default

Save

في كلتا الحالتين، يمكن إدخال أي قيمة مسموح بها بواسطة مربع النص، استنادًا إلى تكوين المُحسّن المحدد عند إعداد المحفظة الأولية.

كل قيمة، معبر عنها بعدد عشري، تحدد الحد الأدنى والحد الأقصى لوزن المحفظة المخصص لكل فئة أصول محددة.



على سبيل المثال، يؤدي تعيين الحد الأدنى لوزن الأصول إلى 0.05 والحد الأقصى لوزن الأصول إلى 0.25 إلى إعطاء تعليمات للمُحسِّن لإنشاء محفظة حيث تحتفظ كل فئة من فئات الأصول بما بين 5% و25% من إجمالي وزن المحفظة. ينطبق المنطق نفسه عند تعيين الحد الأدنى والحد الأقصى للأوزان الفردية لكل فئة أصول فردية.

8.1.4.1 نطاق شامل ينطبق على جميع فئات الأصول

من الممكن ضبط نطاق فئة الأصول على مستوى المحفظة هنا كما هو موضح

Optimize LONG ONLY

Settings Results

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Asset Class Constraint

Portfolio Level

Min Asset Weight* 0 1 Max Asset Weight*

Single Asset Class Level

Search by asset name

ASSET	MIN	MAX
Commodity	0.00000	1.00000
Cryptocurrency	0.00000	1.00000
Equity	0.00000	1.00000
Fixed Income	0.00000	1.00000
Forex	0.00000	1.00000

Restore default Save

8.1.4.2 النطاق الأدنى والأقصى المحدد لكل فئة من الأصول

يمكن تعيين قيود فئة الأصول الفردية التالية على مستويات الفئات هذه:

- سلعة
- العملات المشفرة
- عدالة
- الدخل الثابت
- الفوركس



Info

Exchanges/Asset Class

Cash Activity

Portfolio

Optimization

Trades

Advanced

Long Only

Long Short

Market Neutral

Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings

Results

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Asset Class Constraint

Portfolio Level

Min Asset Weight*

0

Max Asset Weight*

1

Single Asset Class Level

Search by asset name

ASSET	MIN	MAX		
Commodity	0.00000	1.00000		
Cryptocurrency	0.00000	1.00000		
Equity	0.00000	1.00000		
Fixed Income	0.00000	1.00000		
Forex	0.00000	1.00000		

Restore default

Save

8.1.5 القيود القطاعية

تحدد معايير القطاع حدود تعرض المحفظة لقطاعات صناعية محددة

→ مستوى محفظة التطبيقات

الأسهم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول

العدد العشري [0,1] →، للفهرسة المباشرة الطويلة فقط → حقل

المحايد الطويل القصير [-1,1] → للسوق العشري → مجال

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسّن

يمكن تعيين المعلمات التالية لكل قطاع ويتم تفصيلها في قسم خاص بها أدناه

- مجموعة بطانيات تناسب جميع القطاعات
- نطاق الحد الأدنى والحد الأقصى المحدد لكل قطاع



Info

Exchanges/Asset Class

Cash Activity

Portfolio

Optimization

Trades

Advanced

Long Only

Long Short

Market Neutral

Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings

Results

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Sector Constraint

Portfolio Level

Min Sector Weight*

0

Max Sector Weight*

1

Single Sector Level

Search by sector name

Sector	MIN	MAX		
Communication Services	0.00000	1.00000		
Consumer Discretionary	0.00000	1.00000		
Consumer Staples	0.00000	1.00000		
Energy	0.00000	1.00000		
Financials	0.00000	1.00000		

Restore default

Save

في كلتا الحالتين، يمكن إدخال أي قيمة مسموح بها بواسطة مربع النص، استناداً إلى تكوين المُحسّن المحدد عند إعداد المحفظة الأولية.

كل قيمة، معبر عنها كعدد عشري، تحدد الحد الأدنى والحد الأقصى لوزن المحفظة المخصص لكل قطاع محدد.

على سبيل المثال، يؤدي تعيين الحد الأدنى لقطاع الأصول إلى 0.05 والحد الأقصى لقطاع الأصول إلى 0.2 إلى توجيه المُحسّن لإنشاء محفظة يحتفظ كل قطاع فيها بما بين 5% و20% من إجمالي وزن المحفظة.

ينطبق المنطق نفسه عند تحديد الحد الأدنى والحد الأقصى للأوزان الفردية لكل متاح لكل قطاع فردي.



8.1.5.1 مجموعة البطانيات تنطبق على جميع القطاعات

يمكن ضبط نطاق قطاع البطانية هنا على النحو المبين:

Info

Exchanges/Asset Class

Cash Activity

Portfolio

Optimization

Trades

Advanced

Long Only

Long Short

Market Neutral

Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings

Results

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Sector Constraint

Portfolio Level

Min Sector Weight*

0

Max Sector Weight*

1

Single Sector Level

Search by sector name

Sector	MIN	MAX
Communication Services	0.00000	1.00000
Consumer Discretionary	0.00000	1.00000
Consumer Staples	0.00000	1.00000
Energy	0.00000	1.00000
Financials	0.00000	1.00000

Restore default

Save

8.1.5.2 نطاق الحد الأدنى والحد الأقصى المحدد لكل قطاع

يمكن وضع القيود القطاعية الفردية التالية على مستويات القطاعات هذه:

- خدمات الاتصالات
- السلع الاستهلاكية التقديرية
- السلع الاستهلاكية الأساسية
- طاقة
- الشؤون المالية
- الرعاية الصحية
- الصناعات
- تكنولوجيا المعلومات
- مواد
- العقارات
- المرافق



InfoExchanges/Asset ClassCash ActivityPortfolioOptimizationTrades

Advanced

Long OnlyLong ShortMarket NeutralIndexing

Optimize LONG ONLY

SettingsResults

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Sector Constraint

Sector Constraint

Portfolio Level

Min Sector Weight*0Max Sector Weight*1

Single Sector Level

Search by sector name

Sector	MIN	MAX		
Communication Services	0.00000	1.00000		
Consumer Discretionary	0.00000	1.00000		
Consumer Staples	0.00000	1.00000		
Energy	0.00000	1.00000		
Financials	0.00000	1.00000		

Restore default

Save



8.1.6 القيود الجغرافية

تحدد معالم المنطقة الجغرافية حدود تعرض المحفظة لقطاعات صناعية محددة

→ مستوى محفظة التطبيقات

الأسهم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول

العدد العشري [0,1] →، للفهرسة المباشرة الطويلة فقط → حقل

المحايد الطويل القصير [-1,1] → للسوق العشري → مجال

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسّن

يمكن تعيين المعالم التالية لكل منطقة جغرافية ويتم تفصيلها في قسم خاص بها أدناه

- مجموعة بطانيات تناسب جميع القطاعات
- نطاق الحد الأدنى والحد الأقصى المحدد لكل قطاع

Long Only

Long Short

Market Neutral

Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings

Results

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Geographical Constraint

Portfolio Level

Min Zone Weight*

0

Max Zone Weight*

1

Single Geographical Level

Search by zone name

Zone	MIN	MAX		
Africa	0.00000	1.00000		
Asia Pacific	0.00000	1.00000		
Europe	0.00000	1.00000		
Latin America	0.00000	1.00000		
North America	0.00000	1.00000		

Restore default

Save

في كلتا الحالتين، يمكن إدخال أي قيمة مسموح بها بواسطة مربع النص، استنادًا إلى تكوين المُحسّن المحدد عند إعداد المحفظة الأولية.

كل قيمة، معبر عنها كعدد عشري، تحدد الحد الأدنى والحد الأقصى لوزن المحفظة المخصص لكل منطقة جغرافية محددة

على سبيل المثال، يؤدي تعيين الحد الأدنى لوزن الموقع الجغرافي الشامل إلى 0.01 والحد الأقصى لوزن الموقع الجغرافي إلى 0.25 إلى توجيه المُحسّن لإنشاء محفظة حيث تحتفظ كل منطقة جغرافية بما بين 1% و25% من إجمالي وزن المحفظة



8.1.6.1 مجموعة بطانيات تنطبق على جميع المناطق الجغرافية

يمكن ضبط نطاق المنطقة الجغرافية الشاملة هنا على النحو المبين:

Long OnlyLong ShortMarket NeutralIndexing

Optimize LONG ONLY

SettingsResults

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Geographical Constraint

Portfolio Level

Min Zone Weight*

0

Max Zone Weight*

1

Single Geographical Level

Search by zone name

Zone	MIN	MAX		
Africa	0.00000	1.00000		
Asia Pacific	0.00000	1.00000		
Europe	0.00000	1.00000		
Latin America	0.00000	1.00000		
North America	0.00000	1.00000		

Restore default

Save

72صفحة |



8.1.6.2 نطاق الحد الأدنى والحد الأقصى المحدد لكل منطقة جغرافية

يمكن تعيين القيود الجغرافية الفردية التالية على مستويات المنطقة الجغرافية هذه:

- أمريكا الشمالية
- أوروبا
- آسيا
- أمريكا اللاتينية
- أفريقيا

Long OnlyLong ShortMarket NeutralIndexing

Optimize LONG ONLY

SettingsResults

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Geographical Constraint

Portfolio Level

Min Zone Weight*0Max Zone Weight*1

Single Geographical Level

Search by zone name

Zone	MIN	MAX		
Africa	0.00000	1.00000		
Asia Pacific	0.00000	1.00000		
Europe	0.00000	1.00000		
Latin America	0.00000	1.00000		
North America	0.00000	1.00000		

Restore defaultSave



8.1.7 القيود المفروضة على الدولة

يحدد قيد الدولة حدودًا لتعرض المحفظة لمواقع محددة في دول معينة.

→ مستوى محفظة التطبيقات

الأسهم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول

العدد العشري [0,1] →، للفهرسة المباشرة الطويلة فقط → حقل

المحايد الطويل القصير [-1,1] → للسوق العشري → مجال

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسّن

يمكن تعيين المعلمات التالية لكل بلد ويتم تفصيلها في القسم الخاص بها أدناه:

1. مجموعة بطانيات تناسب جميع القطاعات
2. نطاق الحد الأدنى والحد الأقصى المحدد لكل قطاع

Info

Exchanges/Asset Class

Cash Activity

Portfolio

Optimization

Trades

Advanced

Long Only

Long Short

Market Neutral

Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings

Results

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Country Constraint

Portfolio Level

Min Country Weight*

0

Max Country Weight*

1

Single Country Level

Search by country name

Country	MIN	MAX		
Australia	0.00000	1.00000		
Austria	0.00000	1.00000		
Belgium	0.00000	1.00000		
Brasil	0.00000	1.00000		
Canada	0.00000	1.00000		

Restore default

Save

في كلتا الحالتين، يمكن إدخال أي قيمة مسموح بها بواسطة مربع النص، استنادًا إلى تكوين المُحسّن المحدد عند إعداد المحفظة الأولية.

كل قيمة، معبر عنها بعدد عشري، تحدد الحد الأدنى والحد الأقصى لوزن المحفظة المخصص لكل بلد محدد.



على سبيل المثال، يؤدي تعيين الحد الأدنى لوزن الدولة إلى 0.01 والحد الأقصى لوزن الدولة إلى 0.25 إلى توجيه المحسّن لإنشاء محفظة حيث تحتفظ كل منطقة دولة بما بين 1% و25% من إجمالي وزن المحفظة.

8.1.7.1 مجموعة البطانيات تنطبق على جميع البلدان - ما لم يُنص على خلاف ذلك

يمكن ضبط نطاق بطانية الدولة هنا على النحو المبين:

InfoExchanges/Asset ClassCash ActivityPortfolioOptimizationTradesAdvanced

Long OnlyLong ShortMarket NeutralIndexing

Optimize LONG ONLY

SettingsResults

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Country Constraint

Portfolio Level

Min Country Weight*0Max Country Weight*1

Single Country Level

Search by country name

Country	MIN	MAX		
Australia	0.00000	1.00000		
Austria	0.00000	1.00000		
Belgium	0.00000	1.00000		
Brasil	0.00000	1.00000		
Canada	0.00000	1.00000		

Restore defaultSave



8.1.7.2 نطاق الحد الأدنى والحد الأقصى المحدد لكل بلد

الأسهم الفردية → لإعداد المحفظة الأولية ضمن منطقة SETP 3 قيودًا على كل البلدان المغطاة والتي يمكن رؤيتها في PoMaTo →.

بشكل عام، هناك

- دول في آسيا 8
- دولة في أوروبا 24
- دولتان في أمريكا الشمالية
- دولتان في أمريكا اللاتينية

Info

Exchanges/Asset Class

Cash Activity

Portfolio

Optimization

Trades

Advanced

Long Only

Long Short

Market Neutral

Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings

Results

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Country Constraint

Portfolio Level

Min Country Weight*

0

Max Country Weight*

1

Single Country Level

Search by country name

Country	MIN	MAX
Australia	0.00000	1.00000
Austria	0.00000	1.00000
Belgium	0.00000	1.00000
Brasil	0.00000	1.00000
Canada	0.00000	1.00000

Restore default

Save



8.1.8 قيود أمنية فردية

→ مستوى أمان التطبيق

الأسهم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول
 العدد العشري [0,1] →، للفهرسة المباشرة الطويلة فقط → حقل
 المحاييد الطويل القصير [-1,1] → للسوق العشري → مجال
 طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسَّن

تنطبق قيود الأمان الفردية على مستوى الأمان الفردي، مما يؤدي إلى تحديد حدود الحد الأدنى والأقصى للوزن لضمان عدم احتفاظ المحفظة بأكثر من مبلغ محدد من أي أمان فردي.

يمكن أن تكون المعلومات التالية لكل أمان فردي ويتم تفصيلها في قسم خاص بها أدناه:

- مجموعة شاملة تنطبق على جميع الأوراق المالية
- النطاق الأدنى والأقصى المحدد لكل ورقة مالية فردية

The screenshot shows the 'Optimization' tab in a trading platform. The sidebar on the left lists various constraint categories: Market and Cash Constraint, Model Constraint, Risk Constraint, Asset Class Constraint, Sector Constraint, Geographical Constraint, Country Constraint, **Single Security Constraint** (highlighted with a red arrow), Fixed Income Specific Constraint, and Custom Constraint. The main panel is titled 'Single Security Constraint' and contains two sections: 'Portfolio Level' and 'Security Level'. Under 'Portfolio Level', there are input fields for 'Single Stock Min Weight*' (set to 0) and 'Single Stock Max Weight*' (set to 0.075). Under 'Security Level', there is an 'Add' button and a search bar labeled 'Search by security name'. Below the search bar is a table with columns 'Security', 'MIN', and 'MAX', which currently shows 'No records to display'. At the bottom of the panel, there are 'Restore default' and 'Save' buttons.

8.1.8.1 مجموعة شاملة تنطبق على جميع أنواع الأمن
 يمكن ضبط نطاق الأمان الشامل هنا على النحو الموضح



Info

Exchanges/Asset Class

Cash Activity

Portfolio

Optimization

Trades

Advanced

Long Only

Long Short

Market Neutral

Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings

Results

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Single Security Constraint

Portfolio Level

Single Stock Min Weight*

0

Single Stock Max Weight*

0.075

Security Level

Add

Search by security name

Security	MIN	MAX
No records to display		

Restore default

Save

8.1.8.2 نطاق الحد الأدنى والحد الأقصى المحدد لأمن معين

لتحديد الحد الأدنى والأقصى للوزن لأمن معين، اتبع الخطوات التالية

1. Min وMax إضافة الأمان: انقر فوق الزر "إضافة" لفتح نافذة منبثقة للبحث عن الأمان الذي يحتاج إلى وجود قيد الشامل Min وMax مختلف عن قيد.
2. ضبط الأوزان: بعد اختيار الورقة المالية، أدخل الحد الأدنى والأقصى للوزن المطلوب. ينطبق هذا على الورقة المالية فقط.
3. تأكيد الإدخال: بعد إدخال القيم، قم بتأكيد الاختيار لتطبيق القيد.



InfoExchanges/Asset ClassCash ActivityPortfolioOptimizationTrades

Advanced

Long OnlyLong ShortMarket NeutralIndexing

Optimize LONG ONLY

SettingsResults

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Single Security Constraint

Portfolio Level

Single Stock Min Weight*0Single Stock Max Weight*0.075

Security Level

Add

Search by security name

Security	MIN	MAX
No records to display		

Restore defaultSave

Security level weight

Security*Telecom Italia SpA

Single Stock Min Weight*0.01

Single Stock Max Weight*0.05

CancelConfirm

في كلتا الحالتين، يمكن إدخال أي قيمة مسموح بها بواسطة مربع النص، استنادًا إلى تكوين المُحسّن المحدد عند إعداد المحفظة الأولية.

كل قيمة، معبر عنها كعدد عشري، تحدد الحد الأدنى والحد الأقصى لوزن المحفظة لأي أمان.



على سبيل المثال، إذا تم تعيين الحد الأدنى للوزن الشامل على 0 والحد الأقصى على 0.05، فسوف يكون المحسّن ملزمًا بإنشاء %محفظة يمكن فيها الاحتفاظ بأي أمان مؤهل بوزن لا يزيد عن 5

ينطبق المنطق نفسه عند تعيين قيود الحد الأدنى والحد الأقصى للوزن للأوراق المالية الفردية - حيث ستطبق هذه الحدود على الأوراق المالية المحددة على وجه التحديد

عندما يتم تشغيل المحسّن في تكوين الفهرسة المباشرة، سيتم ملء صفحة قيد الأمان الفردي تلقائيًا بالأوراق المالية التي تشكل مؤشر المعيار المحدد أثناء إعداد المحفظة الأولية

في وضع الفهرسة المباشرة، يتم ضبط الحد الأدنى والحد الأقصى للأوزان مسبقًا بناءً على انحراف مُحدد مسبقًا عن وزن المعيار. هذه القيم الافتراضية غير مرئية، ولكن يُمكن تعديلها عند الحاجة

يمكن إضافة أوراق مالية إضافية دون قيود فيما يتعلق بمكونات المؤشر المرجعي، بشرط أن يتم تداولها في نفس البورصة التي يتم تداول المؤشر المرجعي فيها

8.1.8.3 استيراد ملف قيد أمان واحد

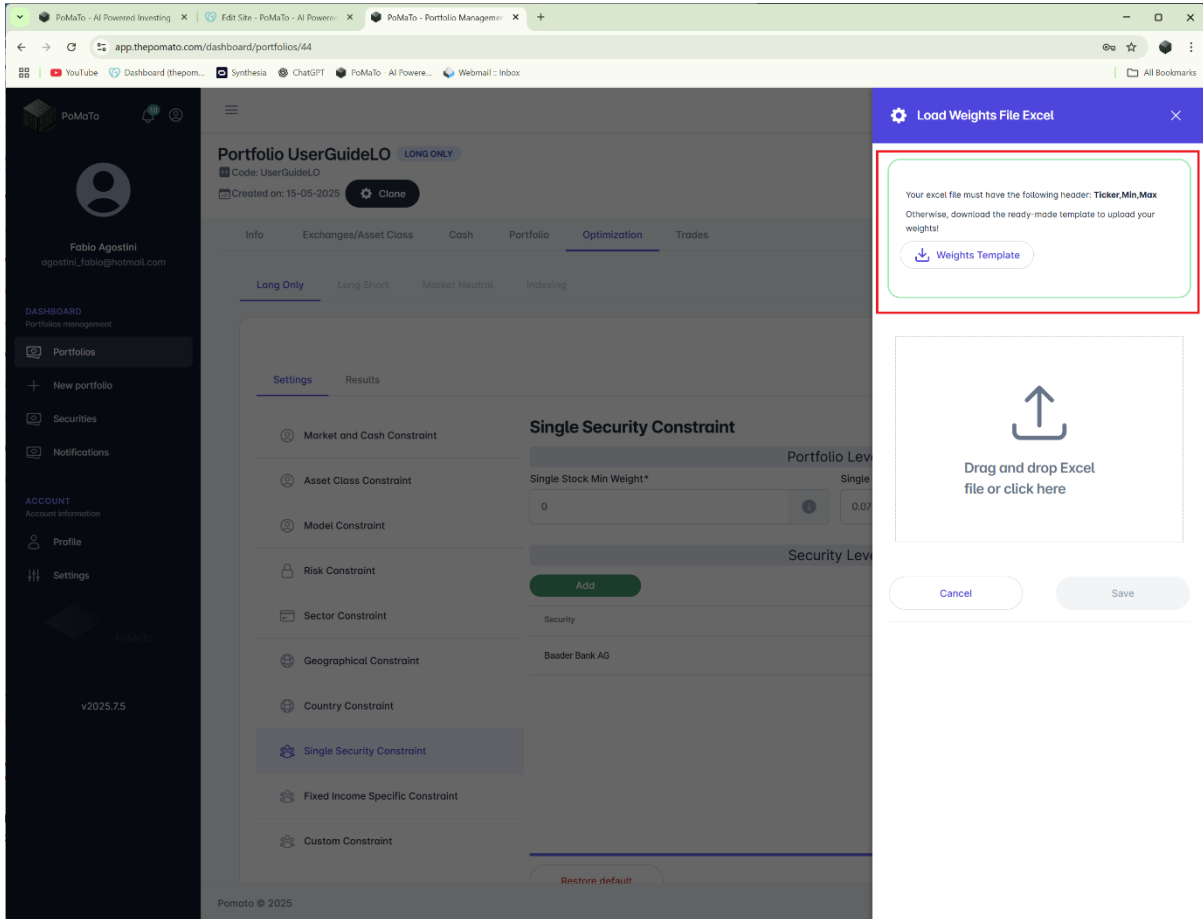
انقر فوق الرمز الأحمر - CSV يمكن أيضًا تسجيل الصفقات بالجملة عن طريق استيراد ملف

استيراد ملف قيد أمان واحد يحتوي على البيانات التي سيتم استخدامها بواسطة المُحسّن

انقر على **اللون الأحمر** زر التحميل كما هو موضح في لقطة الشاشة



قالبًا يمكن تنزيله باستخدام الزر الأحمر PoMaTo لتسهيل تحميل قيد الأمان الفردي، يوفر



بمجرد تنسيق الملف بشكل صحيح، يمكن إسقاط الملف حيثما هو محدد

8.1.9 قيود الدخل الثابت

يمكن تعيين المعلمات التالية لقيود الدخل الثابت ويتم تفصيلها في قسم خاص بها أدناه

- مدة
- أئمر
- التقييم – مستوى المحفظة
- التقييم – مستوى الأمان



InfoExchanges/Asset ClassCash ActivityPortfolioOptimizationTrades

Advanced

Long OnlyLong ShortMarket NeutralIndexing

Optimize LONG ONLY

SettingsResults

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Portfolio Level

Min Duration Required*

Max Duration Required*

0

1

Min Yield Required*

Max Yield Required*

0

1

Min Rating Required*

Max Rating Required*

NR

AAA

Single Rating Level

Min AAA*

Max AAA*

0

1

Min AA+*

Max AA+*

0

1

Min AA*

Max AA*

0

1

Min AA-*

Max AA-*

0

1

Min A+*

Max A+*

0

1

Min A*

Max A*

0

1

Min A-*

Max A-*

0

1

Min BBB+*

Max BBB+*

0

1

Min BBB*

Max BBB*

0

1

Min BBB-*

Max BBB-*

0

1

Min RR+*

Max RR+*



8.1.9.1 مدة

مستوى محفظة
الأصول الدخل الثابت → فئة → التطبيقات
العشري [0,100] → الحقل
طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسَّن

.تقيس المدة الوقت الذي يستغرقه المستثمر، بالسنوات، للحصول على سعر السند من خلال إجمالي تدفقاته النقدية.
 .يمكن تحديد كل من الحد الأدنى والحد الأقصى لمدة المحفظة عن طريق إدخال قيمة بين 0 و100

تمثل القيم المدخلة الحد الأدنى والحد الأقصى للمدة لمحفظة الدخل الثابت الإجمالية، والتي يتم حسابها كمجموع حاصل ضرب الأوزان والمدة لكل ورقة مالية

على سبيل المثال، إذا تم تعيين الحد الأدنى للمدة إلى 1.5 والحد الأقصى إلى 10، فسيتم تقييد المُحسَّن بإرجاع محفظة حيث يكون متوسط المدة المرجحة للممتلكات 1.5 على الأقل ولكن ليس أكبر من 10

تجدر الإشارة إلى أن هذا القيد ينطبق على مستوى المحفظة من حيث العائد المتوسط المرجح، مما يعني أن المحفظة قد تتضمن سندات ذات قسيمة صفرية

8.1.9.2 أئمر

→ مستوى محفظة التطبيقات
الدخل الثابت → فئة الأصول
العشري [0,1] → الحقل
طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسَّن

.يوفر العائد، في سياق الدخل الثابت، مقياسًا للدخل الناتج نسبة إلى تكلفة الاستثمار
 ،يشير العائد إلى العائد الذي يتوقع المستثمر الحصول عليه من السند خلال فترة زمنية محددة. ويُعبَّر عنه بنسبة مئوية سنوية مع مراعاة مدفوعات الفائدة وسعر السند

يتم تحديد قيم الحد الأدنى والأقصى للعائد على مستوى المحفظة. تُحدد هذه القيم الحد الأدنى والأقصى للعائد لمحفظة الدخل الثابت الإجمالية، محسوبةً بمجموع حاصل ضرب الوزن والعائد لكل ورقة مالية

على سبيل المثال، إذا تم تعيين الحد الأدنى للعائد على 0.01 والحد الأقصى على 0.05، فسوف يكون المحسن ملزماً ببناء %محفظة حيث يكون متوسط العائد المرجح 1% على الأقل ولكن ليس أكبر من 5

تجدر الإشارة إلى أن هذا القيد ينطبق على مستوى المحفظة من حيث العائد المتوسط المرجح، مما يعني أن المحفظة قد تتضمن سندات ذات قسيمة صفرية

8.1.9.3 التقييم – مستوى المحفظة

→ مستوى محفظة التطبيقات
الدخل الثابت → فئة الأصول
VarChar [NR, AAA] → حقل
طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسَّن



يشير التصنيف الائتماني إلى تقييم تجريه وكالات التصنيف الائتماني لتقييم الجدارة الائتمانية لجهة إصدار السند. تشير هذه التصنيفات إلى احتمالية قدرة الجهة المصدرة على الوفاء بالتزاماتها المالية، بما في ذلك سداد الفوائد وأصل الدين في مواعيدهما. ويستخدم المستثمرون هذه التصنيفات لتقييم المخاطر المرتبطة بالاستثمار في أداة دخل ثابت محددة.

تعتبر الأوراق المالية ذات التصنيف الأعلى أكثر أمانًا بشكل عام ولكنها تقدم عوائد أقل، في حين أن الأوراق المالية ذات التصنيف الأقل قد تقدم عوائد أعلى للتعويض عن المخاطر المتزايدة.

يُحدّد الحد الأدنى والحد الأقصى لتصنيف العائد على مستوى المحفظة. تُحدّد القيم الأبجدية الحد الأدنى والحد الأقصى لتصنيف محفظة الدخل الثابت الإجمالية، محسوبةً بمجموع حاصل ضرب الوزن والعائد لكل ورقة مالية.

فسوف يكون AAA، وتم تعيين الحد الأقصى للتقييم على BBB على سبيل المثال، إذا تم تعيين الحد الأدنى للتقييم على ولكن أقل من أو يساوي BBB المحسّن ملزمًا بإرجاع محفظة حيث يكون مجموع حاصل الأوزان وعائد الممتلكات على الأقل AAA.

ملاحظة: ينطبق هذا القيد على مستوى المحفظة من حيث متوسط التصنيف المرجح، مما يعني أن المحفظة قد تتضمن أوراق CCC مالية حاصلة على تصنيف.

8.1.9.4 التقييم – مستوى الأمان

→ مستوى أمان التطبيق

الدخل الثابت → فئة الأصول

العدد العشري [0,1] → ، للفهرسة المباشرة الطويلة فقط → حقل

المحايد الطويل القصير [-1,1] → للسوق العشري → مجال

طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسّن

أيضًا بتطبيق قيود التصنيف على مستوى الأوراق المالية PoMaTo بالإضافة إلى قيود التصنيف على مستوى المحفظة، يسمح هذا يُمكن من التحكم في تعرض المحفظة لتصنيفات ائتمانية محددة، من خلال إلزام المحفظة بامتلاك (أو عدم امتلاك) أوراق مالية تابعة لتصنيف ائتماني مُحدد.

بالنسبة لكل تصنيف متاح، يمكن تحديد الحد الأدنى والحد الأقصى للوزن

فسوف يكون المحسّن ملزمًا ببناء ، AAA على سبيل المثال، إذا تم ضبط الحد الأدنى إلى 0.30 والحد الأقصى إلى 0.75 للتقييم . %على الأقل ولكن لا يزيد عن 75 30% AAA محفظة حيث يكون الوزن الإجمالي للأوراق المالية المصنفة

8.1.10 القيود المخصصة

بنهج يركز على العميل. على الرغم من أن إعدادات المُحسّن المتاحة تُلبّي معظم المتطلبات، إلا أن الميزات الإضافية PoMaTo تُتيح تضمين قيود مُخصصة. يُمكن هذا المُحسّن من دمج بيانات خارجية - مثل التصنيفات، والعوائد المتوقعة، أو أي مُدخلات أخرى ذات صلة - لبناء محفظة مُخصصة.

يمكن إضافة البيانات المخصصة، المكونة من القيم الرقمية (إما أعداد صحيحة أو أعداد عشرية)، بالطرق التالية

- استيراد ملف بيانات مخصص
- حسب كل أمان



InfoExchanges/Asset ClassCash ActivityPortfolioOptimizationTrades

Advanced

Long OnlyLong ShortMarket NeutralIndexing

Optimize LONG ONLY

SettingsResults

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Custom Constraint

Portfolio Level

Custom Min*-100Custom Max*100

Security Level

Add

Search by security name

SecurityCustom

No records to display

Restore defaultSave

8.1.10.1 استيراد ملف بيانات مخصص

استيراد ملف بيانات مخصص يحتوي على البيانات التي سيستخدمها المحسّن

انقر على **اللون الأحمر** زر التحميل كما هو موضح في لقطة الشاشة

قالبًا يمكن تنزيله باستخدام زر القالب المخصص **PoMaTo** لتسهيل تحميل البيانات المخصصة، يوفر

بمجرد تنسيق ملف البيانات المخصصة بشكل صحيح، يمكن إسقاط الملف حيثما يشار إليه



Info Exchanges/Asset Class Cash Activity Portfolio **Optimization** Trades Advanced

Long Only Long Short Market Neutral Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings Results

- Market and Cash Constraint
- Model Constraint
- Risk Constraint
- Asset Class Constraint
- Sector Constraint
- Geographical Constraint
- Country Constraint
- Single Security Constraint
- Fixed Income Specific Constraint
- Custom Constraint**

Custom Constraint

Portfolio Level

Custom Min* -100 Custom Max* 100

Security Level

Add Search by security name

Security Custom

No records to display

Restore default Save

Created on 15-05-2025 Clone

Info Exchanges/Asset Class Cash Portfolio Optimization Trades

Long Only Long Short **Market Neutral** Indexing

Settings Results

- Portfolio Constraint
- Asset Class Constraint
- Model Constraint
- Risk Constraint
- Sector Constraint
- Geographical Constraint
- Country Constraint
- Single Security Constraint
- Fixed Income Specific Constraint
- Custom Constraint**

Custom Constraint

Portfolio Level

Custom Min* -100 Custom Max* 100

Security Level

Add Search by security name

Security Custom

No records to display

Restore default Save

Load Custom File Excel

Your excel file must have the following header: **Ticker Custom**
Otherwise, download the ready-made templates to upload your custom

Custom Template

Drag and drop Excel file or click here

Cancel Save

8.1.10.2 حسب كل أمان

يمكن أيضًا إدخال بيانات مخصصة لكل ورقة مالية بالنقر على زر "إضافة". ستظهر نافذة منبثقة تتيح لك تحديد ورقة مالية وتعيين قيمة بيانات مخصصة.



Info Exchanges/Asset Class Cash Activity Portfolio **Optimization** Trades Advanced

Long Only Long Short Market Neutral Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings Results

- Market and Cash Constraint
- Model Constraint
- Risk Constraint
- Asset Class Constraint
- Sector Constraint
- Geographical Constraint
- Country Constraint
- Single Security Constraint
- Fixed Income Specific Constraint
- Custom Constraint**

Custom Constraint

Portfolio Level

Custom Min* -100 Custom Max* 100

Security Level

Add

Search by security name

Security Custom

No records to display

Restore default Save

Security custom

Security*

Bayerische Motoren Werke AG

Custom value*

100

Cancel Confirm

بمجرد تحميل البيانات، يمكن تعيين المعلومات التالية:

→ مستوى محفظة التطبيقات
الأسهم، الدخل الثابت، السلع، الفوركس، العملات المشفرة: → فئات الأصول
العشري [-100، +100] → الحقل
طويل فقط، طويل قصير، محايد للسوق، فهرسة مباشرة → مُحسَّن



على سبيل المثال، سيؤدي تعيين الحد الأدنى المخصص إلى 10 والحد الأقصى المخصص إلى 50 إلى مطالبة المُحسِّن بإرجاع محفظة حيث يكون مجموع حاصل ضرب الأوزان والبيانات المخصصة لكل أمان موصى به 10 على الأقل ولكن أقل من أو يساوي 50.

على سبيل المثال، إذا تم تعيين الحد الأدنى المخصص إلى 10 والحد الأقصى المخصص إلى 50، فسوف يقوم المُحسِّن بإرجاع محفظة حيث يكون مجموع حاصل ضرب الأوزان وقيم البيانات المخصصة عبر جميع الأوراق المالية المحددة 10 على الأقل ولكن ليس أكبر من 50.

InfoExchanges/Asset ClassCash ActivityPortfolioOptimizationTradesAdvanced

Long OnlyLong ShortMarket NeutralIndexing

Optimize LONG ONLY

SettingsResults

Market and Cash Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Asset Class Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Single Security Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Custom Constraint

Portfolio Level

Custom Min*-100Custom Max*100

Security Level

Add

Search by security name

SecurityCustom

No records to display

Restore defaultSave

88صفحة |



9 تشغيل المُحسِّن

جاهزًا لتشغيل عملية التحسين PoMaTo يصبح Optimizer، بمجرد اكتمال إعداد

يسعى المُحسِّن إلى إيجاد الحل الرياضي الذي يحقق أقصى قدر من العائد مع تقليل المخاطر إلى أدنى حد، وذلك من خلال اختيار مزيج من الأصول التي تلي جميع القيود المحددة

9.1 تشغيل المُحسِّن

يمكن تشغيل المُحسِّن من خلال النقر فوق زر "تحسين"، الموجود في الجانب الأيمن العلوي من أي علامة تبويب فرعية "قيود التحسين".

بالنقر فوق زر "تحسين"، سيتم نقل المستخدم إلى علامة التبويب الفرعية "النتائج" ضمن علامة التبويب "التحسين"، والتي ستؤكد تشغيل التحسين وتوفر حالة تشغيله.

سيستغرق وقت التشغيل لعملية التحسين على عدد الأوراق المالية التي تدخل في عملية التحسين.

باللون البرتقالي للإشارة إلى التقدم DOING حالة التشغيل مع علامة PoMaTo أثناء تشغيل عملية التحسين، سيعرض.



Info Exchanges/Asset Class Cash Activity Portfolio **Optimization** Trades

Long Only Long Short Market Neutral Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings **Results**

Search by state

Date	Benchmark	Status	State	Constraint
23-09-2025 15:49:02	CAMI World	-	DOING	Check

9.1.1 وقت تشغيل المُحسّن

يُقدّر متوسط وقت المعالجة بحوالي 5 دقائق لمجموعة أوراق مالية تضم أكثر من 40,000 ورقة مالية في جميع فئات الأصول كلما قلّ عدد الأوراق المالية المعنية، قلّ وقت المعالجة.

على سبيل المثال، سوف يستغرق التحسين الذي يشمل 6000 ورقة مالية ما يقرب من 8 دقائق في تشغيله الأول وحوالي 3 دقائق لكل تشغيل لاحق.

إن المدة الأطول للتشغيل الأولي ترجع إلى الحاجة إلى تحميل مجموعة البيانات الكاملة وإنشاء المصفوفات اللازمة وتطبيق جميع القيود ذات الصلة.

من المهم ملاحظة أن العلاقة بين عدد الأوراق المالية والوقت المطلوب ليست خطية، بل أسية. الأوقات المذكورة أعلاه هي للإرشاد فقط، وينبغي اعتبارها إرشادية.

9.2 نتائج التحسين

بمجرد اكتمال عملية التحسين، سيتم عرض معلومات مفصلة حول عملية التحسين، بالإضافة إلى سجل جميع عمليات التشغيل السابقة.

البرتقالي وسيتم ملء جميع الحقول التالية **DOING**:

- التاريخ: تاريخ تشغيل التحسين
- المعيار: المعيار المستخدم لتشغيل التحسين
- أو إذا لم يتمكن المُحسّن من العثور على حل (يُشار إليه بـ **Optimal** يُشار إليه بـ) الحالة: إذا وجد المُحسّن حلاً **Unknown**)
- الحالة: إذا اكتملت عمليات التحسين بنجاح
- القيد: يتيح التحقق من نتائج التحسين مقابل الإعدادات المحددة
- زر الوزن: يعرض نتائج المُحسّن من حيث الأوزان
- التداول: يعرض الصفقات التي اقترحها المُحسّن



Settings

Results

Q

Search by state

Date	Benchmark	Status	State	Constraint
17-09-2025 14:30:38	CAMI EMU	unknown	✓	<div>Check</div> <div>Weights</div> <div>Trade</div> <div>Approve</div>
17-09-2025 10:52:19	CAMI EMU	unknown	✓	<div>Check</div> <div>Weights</div> <div>Trade</div> <div>Approve</div>
17-09-2025 10:11:55	CAMI EMU	-	✗	<div>Check</div> <div>Weights</div> <div>Trade</div> <div>Approve</div>
17-09-2025 09:52:54	CAMI EMU	optimal	✓	<div>Check</div> <div>Weights</div> <div>Trade</div> <div>Approve</div>
17-09-2025 09:14:35	CAMI EMU	unknown	✓	<div>Check</div> <div>Weights</div> <div>Trade</div> <div>Approve</div>
16-09-2025 22:00:36	CAMI EMU	unknown	✓	<div>Check</div> <div>Weights</div> <div>Trade</div> <div>Approve</div>
16-09-2025 19:21:30	CAMI EMU	unknown	✓	<div>Check</div> <div>Weights</div> <div>Trade</div> <div>Approve</div>
16-09-2025 15:12:27	CAMI EMU	unknown	✓	<div>Check</div> <div>Weights</div> <div>Trade</div> <div>Approve</div>
16-09-2025 14:51:53	CAMI EMU	-	✗	<div>Check</div> <div>Weights</div> <div>Trade</div> <div>Approve</div>

9.2.1 الأوزان - تحقق

بعد تشغيل التحسين، يؤدي النقر فوق زر الأوزان إلى فتح علامة تبويب جديدة تعرض نتائج التحسين من حيث الأوزان المخصصة لكل أمان فردي، مع عكس إعدادات التحسين التي تم تكوينها بالكامل.

Info	Exchanges/Asset Class	Cash	Portfolio	Optimization	Trades	Advanced
Long Only						
Long Short						
Market Neutral						
Indexing						
15-05-2025						
Back						
Weights						
Constraint Check						
CSV EXPORT						
Q Search by cash name						
Security						
Weight						
VolksWagen Preferred						
VOW3 GY						
0.0444						
Intesa Sanpaolo SpA						
ISP IM						
0.0750						
A2A SpA						
A2A IM						
0.0237						
Leonardo SpA						
LDO IM						
0.0086						
Stellantis						
STLA IM						
0.0452						
AXA SA						
CS FP						
0.0092						
Air France KLM SA						
AF FP						
0.0198						
BNP Paribas SA						
BNP FP						
0.0749						
Aegon NV						
AGN NA						
0.0030						
Sanofi SA						



من علامة التبويب الفرعية "الأوزان"، يمكن أيضًا تنزيل نتائج التحسين لمزيد من التحليل أو إجراء فحوصات إضافية على أوزان CSV. المحفظة المقترحة - زر تصدير

File Home Insert P		
Calibri		
B I U		
Clipboard		
A1		
	A	B
1	Ticker	Weight
2	VOW3 GY	0.0444
3	ISP IM	0.075
4	A2A IM	0.0237
5	LDO IM	0.0086
6	STLA IM	0.0452
7	CS FP	0.0092
8	AF FP	0.0198
9	BNP FP	0.0749
10	AGN NA	0.003
11	SAN FP	0.0659
12	INGA NA	0.0079
13	SIE GY	0.0052
14	MUV2 GY	0.0093
15	FUR NA	0.0302

9.2.2 فحص القيد

بعد تشغيل التحسين، يؤدي النقر فوق زر "فحص" إلى تمكين مراجعة جميع إعدادات التحسين المدخلة ونتيجة المحسن بالنسبة لتلك الإعدادات، مما يسمح بإجراء ضبط دقيق محتمل

حالة زر "التحقق" إلى:

1. **أخضر**: وجد المُحسّن حلاً، والحالة مثالية. هذا يُشير إلى مراجعة القيود لتحديد إمكانية تعديل الإعدادات لتتوافق بشكل أفضل مع الأهداف المرجوة.
2. **أحمر**: لم يتمكن المُحسّن من إيجاد حل، والحالة غير معروفة. هذا يُشير إلى عدم إمكانية استيفاء بعض القيود، ربما بسبب:
 - a. قيود متضاربة (على سبيل المثال، الحد الأدنى لوزن الأمان بنسبة 1% لشركة فودافون بينما تم تعيين الحد الأقصى لوزن الدولة بالنسبة للمملكة المتحدة على 0).
 - b. القيود التي من المستحيل تلبيتها

، "بالنقر على زر "فحص"، ينتقل المستخدم إلى علامات التبويب الفرعية "فحص القيود" ضمن علامة تبويب "التحسين"، حيث يعرض جميع القيود المطبقة على المُحسّن لكل قيد، تظهر المعلومات التالية:

- الدنيا والقصوى المحددة في إعدادات التحسين
- قيم الحلول التي وجدها المُحسّن
- مؤشر يوضح ما إذا كان القيد قد تم استيفاؤه (أخضر) أم لا (أحمر)

من خلال تحليل نتائج التحسين فيما يتعلق بالإعدادات، قد تكون الخطوات التالية هي:

- الإعدادات الصحيحة التي تمنع المُحسّن من إيجاد الحل



- ضبط إعدادات التحسين
- تقبل نتائج التحسين كما هي

InfoExchanges/Asset ClassCashPortfolioOptimizationTradesAdvanced

Long OnlyLong ShortMarket NeutralIndexing

15-05-2025Back

WeightsConstraint Check

Market and Cash Constraint

Asset Class Constraint

Model Constraint

Risk Constraint

Sector Constraint

Geographical Constraint

Country Constraint

Fixed Income Specific Constraint

Custom Constraint

Market and Cash Constraint

Market and Cash Constraint	MIN	MAX	OPTIMAL	CHECK
Cash	0.01000	0.01000	0.01000	✓
Market Type Developed	0.00000	1.00000	0.99000	✓
Market Type Emerging	0.00000	0.00000	0.00000	✗



9.2.3 فحص وكيل مُحسّن الذكاء الاصطناعي

للمساعدة في استكشاف الأخطاء **AI Optimizer** عندما يتم عرض حالة المُحسّن على أنها غير معروفة ، يمكن تشغيل وكيل وإصلاحها.

سوف يقوم وكيل الذكاء الاصطناعي بما يلي:

- مراجعة إعدادات التحسين.
 - اكتشاف التناقضات أو الصراعات التي ربما تسببت في فشل المُحسّن.
 - توفير التعديلات الموصى بها لمساعدة المحسّن على العمل بنجاح.
- تضمن هذه الميزة التعرف على مشكلات التحسين وحلها بسرعة، مما يدعم عملية إدارة المحفظة بشكل أكثر سلاسة.
- انقر على الرمز حيث هو موضح.

Portfolio Alice College Fund LONG ONLY

Code: College1
Created on: 17-08-2025

€21,010.00
as previous close
0% last day performance
0% compared to the initial value

Info Exchanges/Asset Class Cash Portfolio **Optimization** Trades

Long Only Long Short Market Neutral Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings Results

Search by state

Date	Benchmark	Status	State	Constraint
17-09-2025 14:30:38	CAMI EMU	unknown	✓	Check
17-09-2025 10:52:19	CAMI EMU	unknown	✓	Check
17-09-2025 10:11:55	CAMI EMU	-	✗	Check
17-09-2025 09:52:54	CAMI EMU	optimal	✓	Check
17-09-2025 09:14:35	CAMI EMU	unknown	✓	Check
16-09-2025 22:00:36	CAMI EMU	unknown	✓	Check
16-09-2025 19:21:30	CAMI EMU	unknown	✓	Check



9.2.4 الموافقة على تشغيل التحسين

بمجرد اكتمال تشغيل التحسين بنجاح، يجب النقر فوق زر الموافقة لقفل تشغيل التحسين المخصص للتداول.

Settings

Results

Q

Search by state

Date	Benchmark	Status	State	Constraint			
17-09-2025 14:30:38	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Approve
17-09-2025 10:52:19	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Approve
17-09-2025 10:11:55	CAMI EMU	-	✗	Check	Weights	Trade	Approve
17-09-2025 09:52:54	CAMI EMU	optimal	✓	Check	Weights	Trade	Approve
17-09-2025 09:14:35	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Approve
16-09-2025 22:00:36	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Approve
16-09-2025 19:21:30	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Approve
16-09-2025 15:12:27	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Approve
16-09-2025 14:51:53	CAMI EMU	-	✗	Check	Weights	Trade	Approve

عند النقر على زر "موافقة"، يتم تثبيت عملية التحسين التي ترغب في التداول بها. يتم تفعيل زر التداول لتلك العملية مع تعطيل جميع أزرار التداول الأخرى المرتبطة بأي عملية تحسين ناجحة أخرى.

تضمن هذه العملية الالتزام بجولة تحسين واحدة فقط للتداول في أي وقت محدد، مما يوفر الاتساق ويمنع التنفيذ العرضي للتوصيات القديمة.

Settings

Results

Q Search by state

Date	Benchmark	Status	State	Constraint			
17-09-2025 14:30:38	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Approve
17-09-2025 10:52:19	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Approve
17-09-2025 10:11:55	CAMI EMU	-	✗	Check	Weights	Trade	Approve
17-09-2025 09:52:54	CAMI EMU	optimal	✓	Check	Weights	Trade	Approve
17-09-2025 09:14:35	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Approve
16-09-2025 22:00:36	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Approve
16-09-2025 19:21:30	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Approve
16-09-2025 15:12:27	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Approve
16-09-2025 14:51:53	CAMI EMU	-	✗	Check	Weights	Trade	Approve

10 تداول المحفظة

بعد تداول المحفظة أحد المكونات الرئيسية لإدارة المحفظة، حيث يتيح التتبع الدقيق وتحسين محافظ الاستثمار.



يُمكن تسجيل نشاط التداول لمحاكاة عمليات التنفيذ على مستوى الوسيط. هذا يضمن أن تعكس المحفظة ، **PoMaTo** داخل النقدية الفعلية وممتلكات الأوراق المالية - من حيث الأسماء والكميات - المُحتفظ بها لدى الوسيط أو أمين الحفظ

ثلاث طرق متبادلة لمعالجة أنشطة التداول. جميع الطرق متطابقة في النظام، وهي مصممة لتناسب نوايا **PoMaTo** يوفر التداول المختلفة:

- **PoMaTo** تداول أي أوراق مالية متاحة في
- تداول الأوراق المالية الموجودة حاليًا في المحفظة
- التجارة بناءً على نتائج التحسين

. "يمكنك الوصول إلى وظيفة التداول عبر علامة التبويب "التداول"

بشكل افتراضي، تفتح المنصة علامة التبويب الفرعية "الأوراق المالية" ، حيث يمكن استخدام أي من طرق التداول الثلاثة

The screenshot shows the PoMaTo trading interface. At the top, there are tabs: Info, Exchanges/Asset Class, Cash, Portfolio, Optimization, and Trades (highlighted with a red arrow). Below these are sub-tabs: Security, Holdings, and OPT Recs (also highlighted with a red arrow). The main area displays a table of trades with columns: Date, Security, Quantity, Price, Cost, Fees, and Tot Cost. The table shows three transactions for 25-07-2025: 2invest AG (117 units, 12.2500 price, 1,433.2500 cost, 3.2500 fees, 1,436.5000 total cost), Volkswagen AG (100 units, 100.0000 price, 10,000.0000 cost, 2.0000 fees, 10,002.0000 total cost), and Air France KLM SA (100 units, 100.0000 price, 10,000.0000 cost, 2.0000 fees, 9,998.0000 total cost). Each row includes a 'Buy' or 'Sell' button and a search bar for security names.

Date	Security	Quantity	Price	Cost	Fees	Tot Cost
25-07-2025	2invest AG Type: EQY Country: Germany Trade CCY: EUR	117	12.2500	1,433.2500	3.2500	1,436.5000
25-07-2025	Volkswagen AG Type: EQY Country: Germany Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	10,002.0000
25-07-2025	Air France KLM SA Type: EQY Country: France Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	9,998.0000



PoMaTo 10.1 تداول أي أوراق مالية متاحة داخل

تداول السلة، والتداول التقديري، والتداول الأمثل → الاستخدام في

وهي مناسبة لـ PoMaTo تتيح هذه الميزة تسجيل تداولات أي ورقة مالية متاحة ضمن

1. التداول التقديري

2. تداول السلة

لمراقبة المحفظة دون استخدام المُحسّن، من الممكن تسجيل الصفقات باستخدام هذه الميزة

لتسجيل صفقة، اختر علامة تبويب "الصفقة" ثم علامة التبويب الفرعية "الأوراق المالية". يمكنك تسجيل أي صفقة شراء أو بيع بالنقر على الزر المخصص

Date	Security	Quantity	Price	Cost	Fees	Tot Cost
25-07-2025	Zinvest AG Type: EQY Country: Germany Trade CCY: EUR	117	12.2500	1,433.2500	3.2500	1,436.5000
25-07-2025	Volkswagen AG Type: EQY Country: Germany Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	10,002.0000
25-07-2025	Air France KLM SA Type: EQY Country: France Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	9,998.0000

عند النقر على زر الشراء أو البيع، يتم فتح نافذة منبثقة جديدة حيث يمكن إدخال المعلومات التالية:

- تاريخ التداول:** هو التاريخ الذي تم فيه تنفيذ التداول - بشكل افتراضي سيكون اليوم أو أحدث يوم تداول
- PoMaTo الأمان:** هو الأمان الذي يتم تداوله - يسمح لك الحقل بالبحث عن أي أمان متاح في هذه العملة التي تمت بها التجارة - بشكل افتراضي، العملة هي عملة التداول للأوراق المالية: **CCY** المحددة
- الكمية:** تمثل عدد الأوراق المالية المتداولة
- السعر:** هو سعر تنفيذ الصفقة
- التكلفة:** سيتم ملء الحقل تلقائيًا بقيمة هي كمية الأمان مضروبة في السعر
- الرسوم:** تمثل الرسوم المدفوعة للوسيط لتنفيذ الصفقة
- إجمالي التكلفة:** سيتم ملء الحقل تلقائيًا بقيمة هي سعر أوقات الأمان بالإضافة إلى أي رسوم وساطة مدفوعة



New Buy Trade

Date* 16-05-2025

Security* Volkswagen AG

CCY* EUR

Quantity*

Price*

Cost* 0

Fees* 0

Tot Cost* 0

[Cancel](#) [Confirm](#)

. بعد استكمال كافة الحقول، قم بتأكيد تنفيذ التداول بالضغط على زر التأكيد

يتم عرضها في أسفل الصفحة مع بيانات التداول ذات الصلة ، **PoMaTo** بمجرد معالجة كل عملية تداول بواسطة ومعلومات الأمان.

يظهر الرمز باللون الأخضر لعمليات الشراء وباللون الأحمر لعمليات البيع.

يمكن تعديل بيانات التداول بالنقر على أيقونة القلم الرصاص لتعديل أي أخطاء، أو حذفها بالنقر على أيقونة سلة المهملات.

Info	Exchanges/Asset Class	Cash	Portfolio	Optimization	Trades	Advanced
Security	Holdings	OPT Recs				
Enter a date range						
25-07-2025 - 01-08-2025		Buy	Sell	Search by security name		
Date	Security	Quantity	Price	Cost	Fees	Tot Cost
25-07-2025	2Invest AG Type: EQY Country: Germany Trade CCY: EUR	117	12.2500	1,433.2500	3.2500	1,436.5000
25-07-2025	Volkswagen AG Type: EQY Country: Germany Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	10,002.0000
25-07-2025	Air France KLM SA Type: EQY Country: France Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	9,998.0000

. تنعكس النتائج على الفور في المحفظة ، **PoMaTo** بمجرد تنفيذ الصفقة ومعالجتها بواسطة

10.1.1.1 استيراد ملف تجاري

. انقر فوق الرمز الأحمر - CSV يمكن أيضًا تسجيل الصفقات بالجملة عن طريق استيراد ملف



يجب أن يحتوي كل صف من الملف على صفقة تم تنفيذها، مع نفس مجموعة المعلومات المطلوبة لإدخال الصفقة يدويًا.

Enter a date range

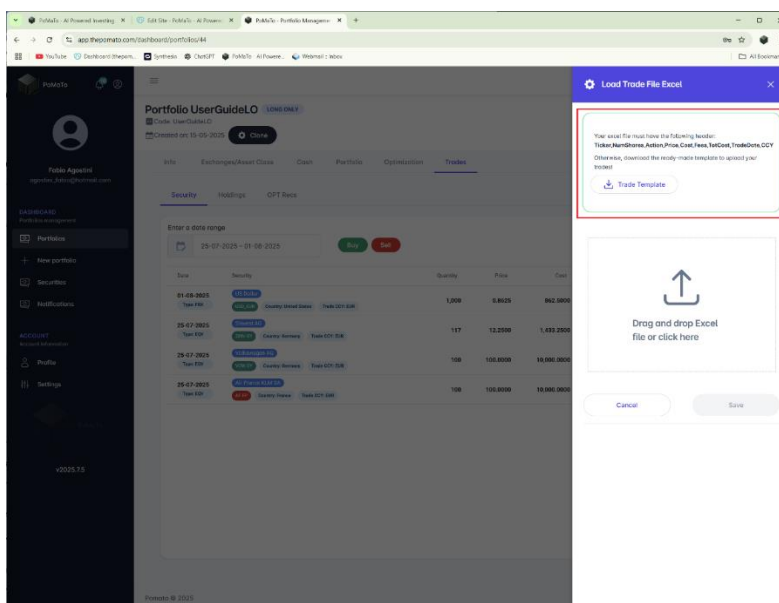
25-07-2025 – 01-08-2025

Buy Sell

Search by security name

Date	Security	Quantity	Price	Cost	Fees	Tot Cost	
25-07-2025	2invest AG Type: EQY Country: Germany Trade CCY: EUR	117	12.2500	1,433.2500	3.2500	1,436.5000	
25-07-2025	Volkswagen AG Type: EQY Country: Germany Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	10,002.0000	
25-07-2025	Air France KLM SA Type: EQY Country: France Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	9,998.0000	

يمكن الحصول على قالب الملف من الزر الأحمر:



نموذج:

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K
1	Ticker	NumShares	Action	Price	Cost	Fees	TotCost	TradeDate	CCY		
2											
3											
4											



10.1.2 تداول الفوركس

هناك حالة خاصة لتداول الفوركس

كما ذكرنا سابقاً، على الرغم من عدم تأثير على القيمة الصافية للأصول عند استخدام الفوركس أو الفوركس، إلا أن الاثنين يخدمان غرضين مختلفين

عندما تظهر عملة غير أساسية في الحساب، فعادةً ما يكون ذلك نتيجة تداول أسهم أجنبية. في هذه الحالة، لا يُقصد بالعملة أن تكون مركز استثمار مُحْتَظ به، بل تُعرض كسطر نقدي يُمكن للمستخدم التفاعل معه عبر علامة التبويب "التداول" (علامة ("التبويب الفرعية "العملات الأجنبية

على العكس من ذلك، عندما يرتبط رصيد العملة باستراتيجية استثمار في سوق الصرف الأجنبي (وبالتالي يُمثل أصلاً)، يجب تصنيفه كأداة فوركس. ويُمثل ذلك زوج العملات

هي عملة السعر ٧٧٧ هي العملة الأساسية و XXX حيث XXX_YYY تظهر أزواج العملات في سوق الفوركس على هيئة

لتتوافق مع ممارسات الوساطة الشائعة (مع ملاحظة أن الاتفاقيات قد تختلف)، تعتبر رسوم تداول الفوركس مدفوعة بالعملة للزوج (٧٧٧) المقابلة

FOREX USD_EUR : فيما يلي مثال على لقطة شاشة لشراء زوج

: انقر على زر الشراء

The screenshot shows a trading platform interface with a 'Trades' tab selected. A date range filter is set to '25-07-2025 - 01-08-2025'. A red arrow points to the 'Buy' button. Below the filter, a table lists trades with columns: Date, Security, Quantity, Price, Cost, Fees, and Tot Cost. The table contains four rows of trade data.

Date	Security	Quantity	Price	Cost	Fees	Tot Cost
01-08-2025	US Dollar Type: FRX USD_EUR Country: United States Trade CCY: EUR	1,000	0.8625	862.5000	1.2500	863.7500
25-07-2025	Zinvest AG Type: EQY ZINV GY Country: Germany Trade CCY: EUR	117	12.2500	1,433.2500	3.2500	1,436.5000
25-07-2025	Volkswagen AG Type: EQY VOW GY Country: Germany Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	10,002.0000
25-07-2025	Air France KLM SA Type: EQY AFKP Country: France Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	9,998.0000



وَأَدْخِلْ بَيَانَاتِ التَّجَارَةِ

- a. **تاريخ التداول** : هو التاريخ الذي تم فيه تنفيذ التداول - بشكل افتراضي سيكون اليوم أو أحدث يوم تداول
- b. في هذا المثال - PoMaTo الأمان : هو الأمان الذي يتم تداوله - يسمح لك الحقل بالبحث عن أي أمان متوفر في يعتبر الدولار الأمريكي شراءً
- c. تشير إلى عملة الاقتباس لزوج الفوركس، كما هو موضح أعلاه. وهي العملة الثانية المدرجة في الزوج. على **CCY**: هي اليورو (CCY) سبيل المثال، في زوج الدولار الأمريكي/اليورو، عملة الاقتباس
- d. في هذه الحالة، الدولار الأمريكي - (FOREX) **الكمية** : تمثل عدد وحدات العملة الأساسية في زوج العملات الأجنبية
- e. **السعر** : هذا هو سعر تنفيذ التداول، أي سعر الصرف بين الدولار الأمريكي واليورو، والذي يمثل سعر صرف الدولار الأمريكي مقابل اليورو
- f. **التكلفة** : سيتم ملء الحقل تلقائيًا بقيمة هي سعر أوقات الأمان
- g. - **الرسوم** : تمثل الرسوم المدفوعة للوسيط لتنفيذ الصفقة، معبرًا عنها بعملة السعر لزوج العملات في الفوركس في هذه الحالة، اليورو
- h. **إجمالي التكلفة** : سيتم ملء الحقل تلقائيًا بقيمة هي سعر أوقات الأمان بالإضافة إلى أي رسوم وساطة مدفوعة

New Buy Trade

Date*

01-08-2025

Security*

US Dollar

CCY*

EUR

Quantity*

1,000

Price*

0.86

Cost*

860

Fees*

1.25

Tot Cost*

861.25

Cancel

Confirm



(FOREX)، إذا كان الوسيط الخاص بك يفرض رسومًا بالعملة الأساسية للحساب أو العملة الأساسية لزوج العملات الأجنبية، عن طريق تقسيم التداول إلى خطوتين PoMaTo فيمكنك التعامل مع هذا في

1. استيراد تجارة الفوركس مع الرسوم المحددة على 0

2. سجل الرسوم بشكل منفصل

ثم اختر "الرسوم" في النافذة المنبثقة لنوع الرسوم. ثم حدد العملة التي ، CC- انتقل إلى علامة التبويب "النقد"، واختر. دُفعت بها الرسوم، وأدخل مبلغ الرسوم الذي فرضه وسيطك

Info Exchanges/Asset Class **Cash** Portfolio Optimization Trades Advanced

Enter a date range
25-07-2025 – 01-08-2025 X

Deposit/Withdraw FX **Cash**

CC CC Search by cash name

Date Cash Quantity Type

No records to display

New cash registration

Type*
FEES

Date*
01-08-2025

Cash currency*
EUR

Quantity*
0.25

Cancel Confirm



10.2 الأوراق المالية المملوكة في المحفظة التجارية

للتداول التقديري والتداول المتعلق بالإجراءات المؤسسية → الاستخدام

تتيح هذه الميزة وتُسهّل تسجيل صفقات الأوراق المالية المُحتفظ بها حاليًا في المحفظة. وهي مناسبة لـ

1. التداول التقديري

2. التداول المتعلق بالإجراءات المؤسسية

نافذة **PoMaTo** لتسجيل صفقة، اختر علامة التبويب "التداول" ثم علامة التبويب الفرعية "الاحتفاظ". سيعرض
تُدرج جميع الأوراق المالية المملوكة حاليًا مع كمياتها

. بالنسبة لكل أمان، تتوفر أزرار الشراء والبيع

Info	Exchange	Asset Class	Cash	Portfolio	Optimization	Trades	Advanced
Security	Holdings	OPT Recs					
<div> <div>Search by security name</div> </div>							
Security	Quantity						
2Invest AG ZINV GY	510	Buy	Sell				
Adux SA ALDUX FP	2,424	Buy	Sell				
Aena SME SA AENA SQ	1,010	Buy	Sell				
Aeroporto Guglielmo Marconi di Bolgn SPA ADB IM	5,242	Buy	Sell				
Aib Group PLC AIBG ID	312	Buy	Sell				
Air France KLM SA AF FP	-100	Buy	Sell				
Aixtron SE AIXA GY	550	Buy	Sell				
Alma Media Oyj ALMA FH	919	Buy	Sell				
Alquiber Quality SA ALQ SQ	663	Buy	Sell				
Altamir SCA LTA FP	774	Buy	Sell				
Altri SGPS SA ALTR PL	3,686	Buy	Sell				



عند النقر على " شراء " أو " بيع " ، يتم فتح نافذة منبثقة جديدة حيث يمكن إدخال المعلومات التالية

- a. تاريخ التارد : هو التاريخ الذي تم فيه تنفيذ الصفقة - بشكل افتراضي سيكون اليوم أو أحدث يوم تداول
- b. الأمان : بشكل افتراضي، هذا هو الأمان المرتبط بزر الشراء أو البيع الذي تم النقر عليه
- c. هذه هي العملة التي تمت بها التجارة - بشكل افتراضي، العملة هي عملة التداول للأوراق المالية : CCY المحددة
- d. الكمية : تمثل عدد الأوراق المالية المتداولة
- e. السعر : هو سعر تنفيذ الصفقة
- f. التكلفة : سيتم ملء الحقل تلقائيًا بقيمة هي سعر أوقات الأمان
- g. الرسوم : تمثل الرسوم المدفوعة للوسيط لتنفيذ الصفقة
- h. إجمالي التكلفة : سيتم ملء الحقل تلقائيًا بقيمة هي سعر أوقات الأمان بالإضافة إلى أي رسوم وساطة مدفوعة

New Buy Trade

Date*

16-05-2025

Security*

2Invest AG

CCY*

EUR

Quantity*

117

Price*

12.25

Cost*

1,433.25

Fees*

3.25

Tot Cost*

1,436.5

Cancel

Confirm



. بعد استكمال كافة الحقوق، قم بتأكيد تنفيذ التداول بالضغط على زر التأكيد

ستظهر على صفحة علامة التبويب الفرعية "الأمان" (انظر القسم أعلاه)، إلى PoMaTo، بمجرد معالجة التجارة في جانب التفاصيل الرئيسية حول الأمان

- سيتم عرض رمز الأمان بعلامة خضراء لتجارة الشراء ، وباللون الأحمر لتجارة البيع
 - لتحرير صفقة ، انقر على أيقونة القلم الرصاص وقم بتعديل أي تفاصيل غير صحيحة
 - لحذف صفقة، انقر على أيقونة سلة المهملات
- سيتم حفظ كافة التغييرات تلقائيًا وستنعكس في سجلات محفظتك

Info	Exchanges/Asset Class	Cash	Portfolio	Optimization	Trades	Advanced
Security	Holdings	OPT Recs				
Enter a date range						
25-07-2025 – 01-08-2025		Buy	Sell	Search by security name		
Date	Security	Quantity	Price	Cost	Fees	Tot Cost
25-07-2025	2invest AG Type: EQY Country: Germany Trade CCY: EUR	117	12.2500	1,433.2500	3.2500	1,436.5000
25-07-2025	Volkswagen AG Type: EQY Country: Germany Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	10,002.0000
25-07-2025	Air France KLM SA Type: EQY Country: France Trade CCY: EUR	100	100.0000	10,000.0000	2.0000	9,998.0000

ستظهر النتائج على الفور في محفظتك، PoMaTo، بمجرد تنفيذ عملية التداول ومعالجتها بواسطة

10.3 تداول نتائج التحسين

لتحسين نتائج التداول → استخدم

صُممت هذه الميزة لتسجيل ومعالجة جميع الصفقات التي يقترحها المُحسِّن. وهي مناسبة بشكل خاص لما يلي

1. تحسين التداول
2. تداول السلة لمواءمة المحفظة مع نتائج المُحسِّن

يمكن الوصول إلى هذه الميزة بطريقتين

1. علامة التبويب التحسين
2. علامة التبويب التجارة

سيتم شرح كلتا الطريقتين بالتفصيل أدناه

1. "علامة التبويب التحسين": بعد تشغيل التحسين، أثناء وجودك في علامة التبويب "التحسين".
2. "علامة التبويب الفرعية النتائج"، انقر فوق الزر "التداول".



Portfolio FBAEMU LONG ONLY

Code: Europe

Created on: 14-09-2025 Clone

€1,000,000.00

as previous close

0% last day performance

0% compared to the initial value

Info Exchanges/Asset Class Cash Activity Portfolio Optimization Trades

Long Only Long Short Market Neutral Indexing

Optimize LONG ONLY

Settings Results

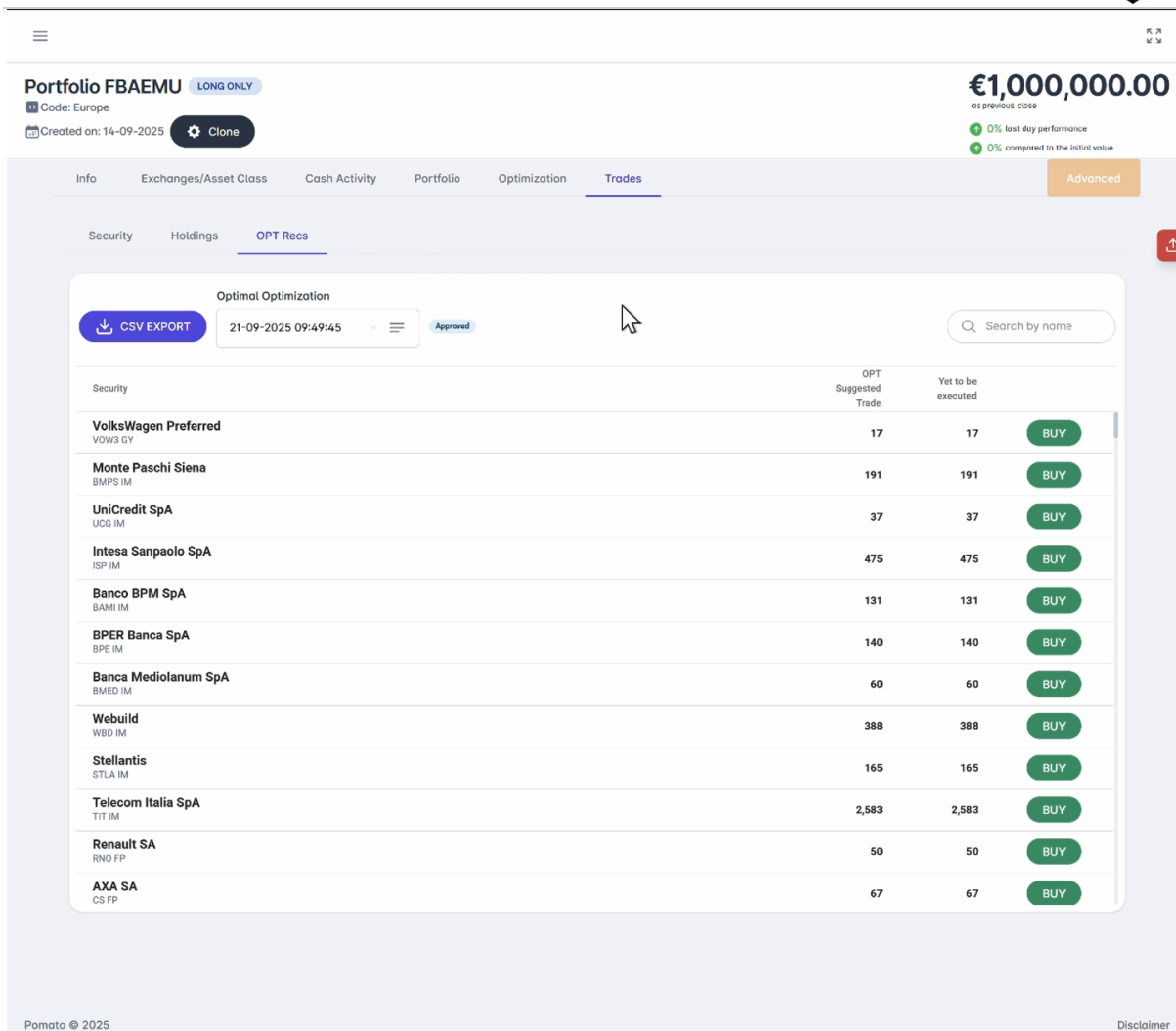
Search by state

Date	Benchmark	Status	State	Constraint	Weights	Trade	Inactive
21-09-2025 15:56:46	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Inactive
21-09-2025 09:49:45	CAMI EMU	optimal	✓	Check	Weights	Trade	Approved
21-09-2025 09:19:14	CAMI EMU	-	✗	Check	Weights	Trade	Inactive
18-09-2025 11:33:02	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Inactive
18-09-2025 07:41:07	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Inactive
17-09-2025 19:32:03	CAMI EMU	optimal	✓	Check	Weights	Trade	Inactive
17-09-2025 14:30:38	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Inactive
17-09-2025 10:52:19	CAMI EMU	unknown	✓	Check	Weights	Trade	Inactive
17-09-2025 10:11:55	CAMI EMU	-	✗	Check	Weights	Trade	Inactive

Pomato © 2025 Disclaimer

حيث يتم عرض ، "OPT" يقوم النظام بإعادة التوجيه إلى علامة التبويب "التداول" ، علامة التبويب "تداول جميع الصفقات التي يقترحها المحسّن لمواءمة المحفظة الحالية مع المحفظة المثلى

2. علامة تبويب "التداول" : بعد تشغيل التحسين، يُمكنك النقر على علامة تبويب "التداول" ، ثم علامة لعرض جميع الصفقات التي اقترحها المُحسّن لمواءمة المحفظة "OPT" التبويب الفرعية -"تداول الحالية مع المحفظة المثلى
- يُرجى العلم أن الوصول إلى الميزة بهذه الطريقة يعني أنه في حال عدم تشغيل التحسين ليوم التداول الحالي، ستكون الصفحة فارغة



جميع الصفقات التي يقترحها المُحسِّن. لكل ورقة مالية مطلوب تداولها، سيعرض "OPT" علامة التبويب الفرعية - "توصيات" سطر عدة معلومات:

1. اسم الأمان والمعرف
2. يمثل المبلغ الذي سيتم تداوله لمواءمة المحفظة مع المحفظة المثلى - OPT التداول المقترح
3. لم يتم تنفيذه بعد - يمثل الكمية المتبقية التي لا تزال بحاجة إلى التداول لمواءمة المحفظة مع المحفظة المثلى

10.3.1 OPT تسجيل ومعالجة دورات

اعتمادًا على كيفية تنفيذ الصفقات لدى الوسيط، هناك خياران لتسجيل ومعالجة جميع الصفقات: إما جزئيًا أو كليًا

يمكن معالجة الصفقات بطريقتين:

1. معالجة الصفقات أثناء تنفيذها
2. بعد إغلاق السوق، يتم تنفيذ عملية تحميل الجملة للتداول

سيتم شرح كلتا الطريقتين بالتفصيل أدناه.



1. معالجة الصفقات فور تنفيذها : ضمم

هذا الخيار للحالات التي تُراقب فيها الصفقات بنشاط ولا تُنفذ دفعة واحدة، إما بسبب التنفيذ الخوارزمي أو تقسيم الصفقات.
في هذه الحالة، يُمكن تسجيل الصفقات ومعالجتها فور تنفيذها بالنقر على زر "شراء" أو "بيع" للأوراق المالية ذات الصلة التي يقترحها المُحسّن.

يؤدي النقر فوق هذا إلى فتح نافذة جديدة حيث يتم تسجيل الصفقة المنفذة عن طريق إدخال المعلومات التالية:

- تاريخ التارد** : هو التاريخ الذي تم تنفيذ الصفقة فيه - بشكل افتراضي سيكون اليوم
- الأمان** : بشكل افتراضي، هذا هو الأمان المرتبط بزر الشراء أو البيع الذي تم النقر عليه
- CCY** : هذه هي العملة التي تمت بها التجارة - بشكل افتراضي، العملة هي عملة التداول للأوراق المالية : CCY المحددة
- الكمية** : تُمثل عدد الأوراق المالية المتداولة. يتم ضبطها افتراضيًا على الكمية التي يقترحها المُحسّن. يمكن تعديل هذه القيمة لتعكس الكمية الفعلية المتداولة
- السعر** : هو سعر تنفيذ الصفقة
- التكلفة** : سيتم ملء الحقل تلقائيًا بقيمة هي سعر أوقات الأمان
- الرسوم** : تمثل الرسوم المدفوعة للوسيط لتنفيذ الصفقة
- إجمالي التكلفة** : سيتم ملء الحقل تلقائيًا بقيمة هي سعر أوقات الأمان بالإضافة إلى أي رسوم وساطة مدفوعة

New Buy Trade

Date*

11-08-2025

Security*

Abelco Investment Group AB

CCY*

SEK

Quantity*

905,615

Price*

10.2

Cost*

9,237,273

Fees*

2

Tot Cost*

9,237,275

Cancel

Confirm

. بمجرد إدخال كافة القيم، يجب تأكيد تنفيذ التداول بالضغط على زر التأكيد

. **OPT Trade** - فسوف تنعكس في علامة التبويب الفرعية، PoMaTo بمجرد معالجة التجارة بواسطة

الكمية التي لم يتم تنفيذها بعد لإظهار الكمية المتبقية المطلوبة للوصول إلى التعرض الأمثل



الكمية المثالية في عرض التجارة التي اقترحها المُحسّن في الأصل، مما يجعل من السهل معرفة مقدار التجارة المقترحة التي تم تنفيذها حتى الآن.

Info Exchanges/Asset Class Cash Portfolio Optimization Trades Advanced				
Security Holdings OPT Recs				
Optimal Optimization				
<div>CSV EXPORT</div> <div>11-08-2025 16:21:37</div> <div>Approved</div> <div>Search by name</div>				
Security	Optimal Quantity	Yet to be executed		
Abelco Investment Group AB ABIG SS	3,905,615	3,000,000	BUY	
Abivax SA ABVX FP	31	31	BUY	
Aega ASA NOFIN NO	9,633,221	9,633,221	BUY	

ستظهر على الصفحة، حيث يتم عرض جميع بيانات التداول جنبًا إلى PoMaTo، بمجرد معالجة التجارة بواسطة -و- في علامة التبويب الفرعية الأمان OPT Recs جنب مع المعلومات الرئيسية حول الأمان في علامة التبويب

. يظهر رمز الأوراق المالية المتداولة باللون الأخضر للشراء والأحمر للبيع

يمكن تصحيح تفاصيل الصفقة بالنقر على أيقونة القلم وتعديل أي أخطاء. كما يمكن حذف الصفقة بالنقر على أيقونة سلة المهملات

Info

Exchanges/Asset Class

Cash

Portfolio

Optimization

Trades

Advanced

Security

Holdings

OPT Recs

Enter a date range

04-08-2025 – 11-08-2025

Buy

Sell

Search by security name

Date	Security	Quantity	Price	Cost	Fees	Tot Cost	
11-08-2025	Abelco Investment Group AB						
Type: EQY	ABIG SS	Country: Sweden	Trade CCY: SEK	905,615	10.2000	9,237,273.0000	2.0000
						9,237,275.0000	

تنعكس نتائج نشاط التداول على الفور في المحفظة PoMaTo، بمجرد تنفيذ عملية التداول ومعالجتها بواسطة "وتصبح مرئية في علامة التبويب الفرعية "الأمان"

2. بعد إغلاق السوق، قم بتحميل الصفقة المنفذة بكميات كبيرة: تم تصميم

. هذا الخيار لإرسال الصفقات إلى وسيط لتنفيذها كتداول سلة

يمكن إرسال ملف تداول السلة إلى الوسيط عن طريق تنزيل الصفقات المقترحة بواسطة المحسن باستخدام زر CSV تصدير



Info	Exchanges/Asset Class	Cash	Portfolio	Optimization	Trades	Advanced
Security	Holdings	OPT Recs				
Optimal Optimization						
<div> <div>CSV EXPORT</div> <div>11-08-2025 16:21:37</div> <div>Approved</div> <div>Search by name</div> </div>						
Security	Optimal Quantity	Yet to be executed				
Abelco Investment Group AB ABIG SS	3,905,615	3,000,000	BUY			
Abivax SA ABVX FP	31	31	BUY			
Aega ASA NOFIN NO	9,633,221	9,633,221	BUY			
Aegon NV AGN NA	11,796	11,796	BUY			
AFC Enerav nlc						

الذي تم تنزيله ليتوافق مع التنسيق المطلوب لدى الوسيط، بما في ذلك تحديث المعرفات أو CSV يمكن تعديل ملف إضافة أعمدة إضافية لإعدادات التداول الخوارزمية التي سيتم تمريرها إلى الوسيط.

	A	B	C
1	Ticker	Optimal Quantity	Action
2	A2A IM	17452	BUY
3	INGA NA	94	BUY
4	TKA GY	1476	BUY
5	VER AV	58	BUY
6	ETL FP	3050	BUY
7	PROX BB	422	BUY
8	KNEBV FH	60	BUY
9	PSM GY	731	BUY
10	SGL GY	15313	BUY
11	TMV GY	772	BUY
12	CPI LN	772	BUY
13	PTEC LN	915	BUY
14	DBV FP	4171	BUY

في حالة التداول عبر تداول السلة ، سيتم استلام ملف تأكيد من الوسيط - يوضح حالة تنفيذ السلة - بعد إغلاق السوق.

لمعالجة جميع الصفقات المُنفَّذة PoMaTo بمجرد توفر ملف الوسيط، يُمكن تنزيل قالب التداول واستخدامه داخل. يُمكن تحميله إلى شاشة التداول باستخدام الزر الأحمر (يتوفر قالب التحميل أيضًا من هذا الزر).

Info	Exchanges/Asset Class	Cash	Portfolio	Optimization	Trades	Advanced
Security	Holdings	OPT Recs				
Optimal Optimization						
<div> <div>CSV EXPORT</div> <div>11-08-2025 16:21:37</div> <div>Approved</div> <div>Search by name</div> </div>						
Security	Optimal Quantity	Yet to be executed				
Abelco Investment Group AB ABIG SS	3,905,615	3,000,000	BUY			
Abivax SA ABVX FP	31	31	BUY			
Aega ASA	9,633,221	9,633,221	BUY			



بجميع المعلومات التي يقدمها الوسيط PoMaTo يمكن بعد ذلك ملء ملف قالب تداول

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K
1	Ticker	NumShares	Action	Price	Cost	Fees	TotCost	TradeDate	CCY		
2											
3											
4											

فسوف يظهر في أسفل الصفحة، حيث يتم عرض جميع بيانات PoMaTo بمجرد تحميل التداول ومعالجته بواسطة التداول جنبًا إلى جنب مع المعلومات الرئيسية حول الأمان

يظهر مؤشر الأوراق المالية المتداولة **باللون الأخضر** للشراء **والأحمر** للبيع

يمكن تصحيح تفاصيل الصفقة بالنقر على أيقونة القلم لتصحيح أي أخطاء. كما يمكن حذف الصفقة بالنقر على أيقونة سلة المهملات

تنعكس نتائج نشاط التداول على الفور في المحفظة وتصبح مرئية PoMaTo بمجرد تنفيذ التداول ومعالجته بواسطة "في علامة التبويب الفرعية " الأمان



11 الميزات المتقدمة

العديد من الأدوات لصيانة المحفظة والوصول إلى البيانات **Advanced** توفر علامة التبويب ، **PoMaTo** في

1. تدفق

نقدي مفقود عند البدء:

يُتيح هذا الخيار تعديل أو إضافة أي تدفق نقدي مفقود (سطر النقد). هذه الميزة غير مخصصة لتسجيل التدفقات النقدية (الإيداعات أو السحوبات) التي تحدث بعد الإعداد الأولي للمحفظة. صُممت هذه الميزة لتعديل خطوط النقد الأولية المستوردة في **الخطوة 4**. قد تؤثر أي تغييرات على صافي قيمة الأصول التاريخية، وبالتالي على جميع بيانات المحفظة، بما في ذلك أرقام الأداء. يُنصح باستخدام هذه الميزة فقط عند الوعي التام بتأثيرها المحتمل.

2. تحرير المحفظة:

يسمح بتصحيح الأخطاء أو الأخطاء التي حدثت أثناء استيراد المحفظة الأولي في **الخطوة 4**. هذه الميزة غير مخصصة لاستيراد محفظة أولية، وإنما لتصحيح العناصر التي تم استيرادها بشكل غير صحيح. أي تغييرات في وبالتالي على جميع بيانات المحفظة، بما في ذلك الأداء (NAV) هذا القسم قد تؤثر على صافي قيمة الأصول التاريخية والمقاييس ذات الصلة. يُنصح بشدة باستخدام هذه الميزة فقط عند الوعي التام بتأثيرها على بيانات المحفظة التاريخية.

3. تنزيل البيانات:

يتيح الوصول إلى البيانات التي يستخدمها المُحسّن. يشمل ذلك تنزيل مصفوفة التباين-التغاير وقيم بيتا طويلة وقصيرة المدى.

يتم شرح الميزات المتقدمة بالتفصيل أدناه



11.1 النقد - إضافة تدفق البدء المفقود

إذا لم يتم تحميل خط النقد أثناء إنشاء المحفظة الأولية، فيمكن إضافته عن طريق تحديد علامة التبويب خيارات متقدمة ، ثم علامة التبويب الفرعية النقد

هناك طريقتان لإضافة النقود

1. تعديل إدخال سطر النقد الأصلي (إذا تم إدخاله بشكل غير صحيح في البداية) أو
2. إضافة خط نقدي جديد بعملة أخرى غير خط النقد الأولي

11.1.1 تعديل إدخال سطر النقد الأصلي

إذا قمت بإدخال المبلغ النقدي الأولي بشكل غير صحيح، فيمكنك ببساطة النقر فوق رمز القلم الرصاص

Info	Exchanges/Asset Class	Cash Activity	Portfolio	Optimization	Trades	Advanced
Cash	Portfolio Edit	Downloads				
<div> <div>MISSING START FLOW</div> <div>Search by</div> </div>						
Date	Cash	Quantity	Type			
17-09-2025	EUR	10,000.0000	START FLOW	+		
17-09-2025	USD	100,000.0000	START FLOW	+		

ثم في النافذة المنبثقة قم بتعديل المبلغ

سيتم فتح نافذة منبثقة لإدخال القيم التالية

- ؛ ولا يمكن تغيير PoMaTo سيتم تعيين تاريخ التدفق المفقود افتراضيًا إلى تاريخ بدء المحفظة أو تاريخ الإعداد داخل هذا التاريخ.
- عملة التدفق الأولي أو خط العملة المفقود عند إعداد المحفظة
- الكمية (عدد الوحدات) من العملة المحتفظ بها عند الإعداد

يجب التأكيد بعد إدخال التدفق النقدي الجديد



Update START FLOW

Date*

Cash currency*

Quantity*

Cancel

Confirm

11.1.2 إدخال خط نقدي جديد

"الطريقة الأخرى لإضافة خط نقدي هي عن طريق النقر فوق الزر "+ تدفق البدء المفقود

.يرجى ملاحظة أن هذه الطريقة مخصصة لعمليات خطوط النقد الأخرى غير خطوط النقد النقدية الحالية

Info Exchanges/Asset Class Cash Activity Portfolio Optimization Trades

Advanced

Cash Portfolio Edit Downloads

MISSING START FLOW

Search by cash name

Date	Cash	Quantity	Type
17-09-2025	EUR	10,000.0000	START FLOW
17-09-2025	USD	100,000.0000	START FLOW

:من خلال النقر على + تدفق البدء المفقود ، سيتم فتح نافذة منبثقة لإدخال القيم التالية

1. ؛ ولا يمكن تغيير هذا التاريخ PoMaTo تاريخ التدفق المفقود افتراضياً إلى تاريخ بدء المحفظة أو تاريخ الإعداد داخل

2. عملة التدفق الأولي أو خط العملة المفقود عند إعداد المحفظة

3. الكمية (عدد الوحدات) من العملة المحتفظ بها عند الإعداد

.يجب التأكيد بعد إدخال التدفق النقدي الجديد



New cash registration

Date*

17-09-2025

Cash currency*

CHF

Quantity*

10,000,000

Cancel

Confirm

11.2 تحرير المحفظة

تم تصميم هذه الميزة لتصحيح أو تعديل المحفظة المستوردة أصلاً أثناء إعداد الحساب

تعديلات المحفظة بعناية، لأن أي تعديل سيؤثر على تكوين المحفظة وقيمة الأصول الصافية. تسري التغييرات من لحظة تنفيذها، ولا تُطبق بأثر رجعي

سيؤدي تحرير الحيازة اليوم إلى ارتفاع صافي القيمة الأصولية بما يعادل القيمة المعدلة (الحيازة حسب السعر)، وسيتم احتساب هذه القفزة كأداء

بشدة باستخدام هذه الميزة فقط لتصحيح الأخطاء في يوم إنشاء المحفظة أو إعدادها داخل التطبيق. قد تؤدي **PoMaTo** التعديلات اللاحقة إلى معلومات مضللة عن المحفظة

هذه الميزة غير مخصصة لاستيراد أو تسجيل محفظة أولية بعد إعداد الحساب، بل لتصحيح العناصر المستوردة بشكل غير صحيح. أي تغييرات قد تؤثر على صافي قيمة الأصول التاريخية، وبالتالي على جميع بيانات المحفظة المعروضة

من المستحسن استخدام هذه الميزة فقط عند الوعي الكامل بتأثيرها

للوصول إلى **"تحرير المحفظة"**، انقر على علامة التبويب **"خيارات متقدمة"**، ثم حدد **"تحرير"**. تتوفر الإجراءات التالية

1. إضافة أمان فائت
2. تعديل كمية الأوراق المالية المستوردة بشكل خاطئ
3. حذف الأمان الذي تم استيراده بشكل غير صحيح



Info	Exchanges/Asset Class	Cash	Portfolio	Optimization	Trades	Advanced
Cash	Portfolio Edit	Downloads				
<div> <div>+ Security</div> <div>Search by security name</div> </div>						
Security		Quantity				
Abeico Investment Group AB		905,615				
ABIG SS						
EUR		1,000,000.000				
SEK		-9,237,275.000				

11.3 إضافة أمان مفقود

، إذا لم يتم تحميل الأمان أثناء إنشاء المحفظة في الخطوة 4 ، فيمكن إضافته عن طريق تحديد علامة التبويب خيارات متقدمة . واختيار علامة التبويب الفرعية تحرير ، والنقر فوق الزر + الأمان

بالضغط على +الأمان يمكن إدخال الآتي

1. الأمن المراد إضافته

2. الكمية ذات الصلة التي تم الاحتفاظ بها في الأصل

تاريخ الإضافة مُحدد باليوم الحالي ولا يُمكن تغييره. يلزم تأكيد الإضافة خلال عملية التحرير.

Add new security

Date*

19-05-2025

Security*

Volkswagen AG

Quantity*

134

Cancel

Confirm



11.4التنزيلات

بين منصات الاستثمار الاحترافية بانفتاحها وسهولة الوصول إليها. تتيح المنصة للجميع أدوات بمستوى **PoMaTo منصة** المؤسسات، مع ضمان الشفافية، دون تمييز بين عملاء التجزئة والمحترفين والمؤسسات. وتهدف المنصة إلى توفير ميزات كانت مقتصرة سابقًا على المؤسسات لجمهور أوسع بتكلفة منخفضة وشفافية تامة

Info	Exchanges/Asset Class	Cash	Portfolio	Optimization	Trades	Advanced
Cash	Portfolio Edit	Downloads				
File						
Matrix Var Covar						Download
Beta S						Download
Beta L						Download

الوصول المباشر إلى البيانات الرئيسية لتحسين المحفظة. يُمكن **PoMaTo** بخلاف حلول "الصندوق الأسود" التقليدية، يُتيح تنزيل الملفات التالية في أي وقت بعد تشغيل عملية التحسين

1. نموذج المخاطر (مصفوفة التباين-التغاير)
2. بيتا طويلة المدى
3. بيتا قصيرة المدى

يمكن الوصول إلى جميع البيانات من علامة التبويب " خيارات متقدمة" ثم علامة التبويب الفرعية " تنزيل" . انقر على أيّ من يحتوي على البيانات المطلوبة CSV الأزرار الثلاثة المتاحة لتنزيل ملف

11.4.1عينة - Matrix Var Covar

يعد هذا ملفًا كبيرًا للغاية، ويحتوي على أكثر من مليار عنصر بيانات

C:\Users\user\Desktop>dir C:\Users\user\Desktop					
[C:\Users\user\Desktop] The folder contains the following files.					
File Name Size Date Modified					

Matrix Var Covar 1,000,000,000 11/11/2023 10:00:00 AM					
Beta S 1,000,000,000 11/11/2023 10:00:00 AM					
Beta L 1,000,000,000 11/11/2023 10:00:00 AM					
...					



11.4.2 عينة S - بيتا

```
BetaS_59.txt - Notepad
File Edit Format View Help
Ticker Beta
VOW3 GY 0.99
BMPS IM 1.52
UCG IM 1.55
ISP IM 1.43
BAMI IM 1.35
BPE IM 1.41
CE IM 1.1
BDB IM 1.36
IF IM 1.22
G IM 0.96
UNI IM 1.42
MN IM 0.72
RCS IM 0.64
BMED IM 1.48
BZU IM 1.32
CEM IM 0.98
WBD IM 1.5
BRE IM 0.91
Ln 1, Col 1 100% Unix (LF) UTF-8
```

11.4.3 بيتا ل - عينة

```
BetaL_59.txt - Notepad
File Edit Format View Help
Ticker Beta
VOW3 GY 1.12
BMPS IM 1.41
UCG IM 1.44
ISP IM 1.39
BAMI IM 1.16
BPE IM 0.87
CE IM 0.97
BDB IM 0.57
IF IM 0.59
G IM 0.99
UNI IM 0.89
MN IM 0.85
RCS IM 0.87
BMED IM 1.24
Ln 1, Col 1 100% Unix (LF) UTF-8
```



PoMaTo 12 نموذج القيمة النسبية للأسهم في

. PoMaTo نموذج القيمة النسبية للأسهم هو أحد محركات التنبؤ الأساسية في

. إنه يجمع بين تحليل الأسهم الأساسية التقليدي والتنفيذ المنهجي القائم على البيانات

من خلال القضاء على التحيزات البشرية وتطبيق تقنيات المقارنة الصارمة، يتيح نموذج القيمة النسبية للأسهم إنشاء محفظة متسقة وواعية بالمخاطر على أساس التقييم النسبي للأقران

بدلاً من تقييم السهم بمعزل عن غيره، يقارن النموذج كل شركة بأقرب نظيراتها - استناداً إلى الصناعة والقطاع الفرعي والملف المالي - لتحديد ما إذا كانت قيمتها أقل أو أعلى من قيمتها الحقيقية في ظل الظروف الاقتصادية الكلية الحالية

12.1 ما هذا؟

نموذج القيمة النسبية للأسهم هو استراتيجية هجينة تستخدم عمق التقييم التقليدي من الأسفل إلى الأعلى - دون التحيزات البشرية - وتعزز بتقنيات التحليل الكمي المتطورة عبر الأسهم العالمية

النتيجة: اختيار أسهم أكثر اتساقاً ووعياً بالمخاطر استناداً إلى القيمة النسبية للأقران

تم تصميمه لتقييم الأسهم ليس بمعزل عن غيرها، ولكن بالنسبة لأقرب نظيراتها، باستخدام تحليل عميق للبيانات المالية . والسياق الاقتصادي الكلي

الهدف هو تحديد الأسهم التي يتم التقليل من قيمتها الأساسية أو المبالغة في قيمتها مقارنة بالشركات المماثلة، مما يدعم بناء محفظة أكثر كفاءة

12.2 المبادئ الأساسية

- الفلسفة الهجينة : تجمع بين التحليل الأساسي للشركة والتقنيات الكمية المنهجية
- لا تحيز بشري : يستخدم أساليب تعتمد على الآلة للقضاء على الاختصارات العقلية واتخاذ القرارات الذاتية
- التقييم النسبي : يقوم بتحليل الميزانية العمومية لكل ورقة مالية وأدائها مقارنة بمنافسيها المباشرين ومجموعاتها الفرعية في الصناعة
- اختيار الأسهم من الأسفل إلى الأعلى : التركيز على تحديد الأسهم المقومة بأقل من قيمتها الحقيقية - وليس الرهانات القطاعية
- البناء الخاضع للتحكم في المخاطر : تم تحسينه باستخدام نهج التباين الأدنى لتحسين نسب شارب وتقليل التقلبات
- معدل دوران منخفض : تتم إعادة التوازن ربع سنوياً، مما يقلل من تكاليف المعاملات مع الاستمرار في عكس البيانات المالية المحدثة
- عملية آلية : يتم تشغيل النموذج يوميًا ، ولكن يتم التداول فقط بعد التحديثات ذات المغزى (على سبيل المثال (الأرباح الفصلية).

12.3 ماذا يفعل

يقوم نموذج القيمة النسبية للأسهم بتقييم قيمة كل ورقة مالية وقوتها المالية وجودة أرباحها من خلال مقارنتها بمجموعة أقران محددة - عادة على مستوى الصناعة الفرعية (على سبيل المثال، الملابس الفاخرة الأوروبية، البنوك الإقليمية الأمريكية إلخ).

ثم يقوم بعد ذلك بتحليل الإشارات الاقتصادية الكلية (مثل أسعار الفائدة، واتجاهات الناتج المحلي الإجمالي، وضغوط التضخم) لتحديد الأسهم التي



- تم تسعيرها بشكل خاطئ من قبل السوق
- التفوق المالي مقارنة بالأقران
- من المرجح أن تعود أو تتباعد في القيمة في ظل الظروف الاقتصادية السائدة

يدعم هذا النموذج الاستراتيجيات الطويلة والقصيرة والطويلة، وتداولات أزواج القيمة النسبية، والإنشاءات المحايدة للسوق.

12.4 كيف يعمل

تم بناء نموذج حقوق الملكية ذات القيمة النسبية باستخدام إطار عمل متعدد العوامل ، مع الخطوات التالية

1. جمع البيانات

بتصفية الشركات من الأسواق باستخدام معايير مثل PoMaTo تبدأ

- القيمة السوقية
- تعويم حر
- حجم التداول

وهذا ما يحدد عالم الاستثمار

2. تحليل البيانات

- يتم استيعاب أكثر من 20,000 مدخلة في الميزانية العمومية وقائمة الربح والخسارة من أكثر من 32,000 شركة
- يركز هذا التقرير على الأداء التشغيلي التاريخي، وقوة الميزانية العمومية، وجودة التدفق النقدي

3. تعريف الكون الفرعي

- يتم تطبيق إطار القيمة النسبية على مستوى الصناعة الفرعية
- والتصنيف Z يتم مقارنة البيانات المالية لكل أمان مع نظرائه باستخدام درجات
- ويؤدي هذا إلى إنشاء قائمة شراء مفلترة للمرشحين غير المقدرين بقيمتهم الحقيقية

4. الجيل ألفا

- يقوم النموذج بقياس مدى انخفاض قيمة كل سهم عن طريق مقارنة الأساسيات التاريخية وسلوك التسعير
- يتم تقييم الأسهم مع أهداف الأسعار المتوقعة باعتبارها الناتج الأساسي

5. بناء المحفظة

- ببناء محفظة باستخدام قائمة الكون الفرعي فقط PoMaTo
- يتم استخدام خوارزمية التباين الأدنى لتعظيم العائد المعدل حسب المخاطر
- لا يوجد الإفراط في التجهيز أو تحسين القوة الغاشمة - فقط مدخلات قوية وقابلة للتفسير

6. إعادة التوازن

- في حين تتم مراقبة الأسعار يوميًا، يحدث إعادة التوازن الكامل كل ثلاثة أشهر، بما يتماشى مع موسم الأرباح
- ليعكس البيانات المالية الأكثر تحديثًا

12.5 لماذا هو قوي

أكثر قوة من الأساسيات البحتة : بدلاً من القول "إن الشركة (أ) لديها نسبة سعر إلى ربحية جيدة"، يسأل نموذج القيمة النسبية "للأسهم، هل الشركة (أ) رخيصة مقارنة بالشركات الأخرى في نفس مجالها؟

التكيف مع دورات السوق : تضمن الطبقة الكلية عدم الاعتماد على قواعد ثابتة، بل التكيف مع أنظمة السوق

نموذج الأسهم ذات القيمة النسبية لاختيار الأسهم الحديثة ، وهو يدعم الاستراتيجيات الطويلة فقط، والطويلة القصيرة والمحايدة للسوق - مما يوفر أدوات ذات جودة مؤسسية - للمستثمرين الأفراد والمحترفين على حد سواء



فائدة	ميزة
يجمع بين أفضل ما في عالمي الاستثمار	منهجي + أساسي
يتم تقييم النماذج مقارنة بالمنافسين الفعليين، وليس فقط مقارنة بالسوق	الوعي بالأقران
تكييف الأوزان والتوقعات مع الظروف الاقتصادية المتغيرة	حساس للماكرو
يقلل من الضوضاء والتحيز - يتم استخدام البيانات الدقيقة والقابلة للمقارنة فقط	ألفا النظيفة
، تم تصميمه لدعم استراتيجيات المحفظة الطويلة فقط ، والطويلة القصيرة . والمحايدة للسوق	جاهز للاستخدام المهني

PoMaTo12.6 مواقع العرض في

:عند تمكين تبديل "النموذج" أثناء إعداد المحفظة

- سيتم تفعيل نموذج القيمة النسبية للأسهم كعامل رئيسي في محرك التحسين
- ستعكس اقتراحات المحفظة الفرص غير المقدرة والقوة النسبية للأقران
- قد يتم تخفيض أولوية الأوراق المالية ذات الدرجات السلبية في نموذج القيمة النسبية للأسهم أو تمييزها للبيع على المكشوف (في إعدادات البيع على المكشوف الطويل)



13 زائدة

13.1 حساب تعريف

يمكن تغيير الاسم الأول واسم العائلة والبريد الإلكتروني في قسم الملف الشخصي.

The screenshot displays the PoMaTo application interface. On the left, a dark sidebar contains navigation options. Under the 'ACCOUNT' section, the 'Profile' option is highlighted with a red rectangular box. The main content area is titled 'Profile' with a subtitle 'Configure your profile'. It features a form with three input fields: 'Email*', 'First Name*', and 'Last Name*'. Each field is highlighted with a red rectangular box. A 'Save' button is located at the bottom right of the form area.



13.2 إعدادات

يمكن تغيير الإعدادات المختلفة هنا:

1. المنطقة الزمنية

- **الوصف:** يحدد المنطقة الزمنية المستخدمة عبر المنصة، مما يؤثر على الطوابع الزمنية للتداولات والمعاملات ونشاط المحفظة.

- **كيفية التغيير:** انقر على القائمة المنسدلة وحدد المنطقة الزمنية المفضلة لديك (على سبيل المثال، أوروبا/روما).

2. تنسيق التاريخ

- **الوصف:** يحدد كيفية عرض التواريخ (على سبيل المثال، اليوم-الشهر-السنة).
- **كيفية التغيير:** حدد التنسيق المطلوب من القائمة المنسدلة (على سبيل المثال، dd-MM-yyyy).

3. فاصل الآلاف

- **الوصف:** يحدد الرمز المستخدم لفصل الآلاف في الأعداد الكبيرة لتسهيل القراءة (على سبيل المثال، 10000 أو 10000).

- **كيفية التغيير:** اختر بين الفاصلة أو النقطة أو خيارات أخرى من القائمة المنسدلة.

4. موضع رمز العملة

- **الوصف:** يتحكم في ما إذا كان رمز العملة يظهر قبل المبلغ أو بعده (على سبيل المثال، 100 دولار أو دولار 100).
- **كيفية التغيير:** حدد "يسار" أو "يمين" من القائمة المنسدلة.

5. مزود المؤشر



- **الوصف:** يحدد مصدر بيانات المؤشرات المستخدمة لأسعار الأوراق المالية ومعلومات السوق (على سبيل المثال Google).
- **كيفية التغيير:** اختر مزود الخدمة المفضل لديك من القائمة المنسدلة
- **إعداد افتراضي Google افتراضياً:** إذا لم يتم إجراء أي اختيار أثناء الإعداد الأولي، فسيتم تحديد

حفظ التغييرات

بعد تحديد اختياراتك، انقر على زر "حفظ" أسفل اليمين لتطبيق إعداداتك. ستسري التغييرات فوراً على حسابك بالكامل.

13.3 وظائف الدعم

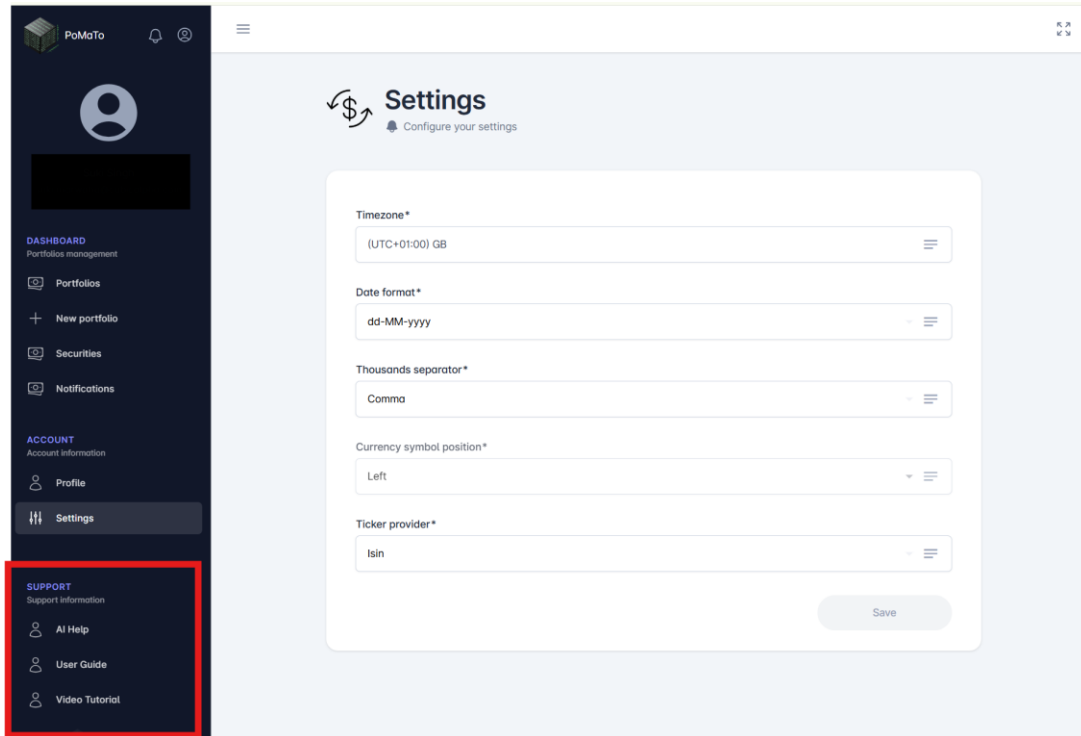
المساعدة والدعم متاحان من قسم الدعم.

يفتح في نافذة جديدة لتتمكن من استخدامه. OpenAI هو دليل المستخدم الإلكتروني، مدعوم بتقنية AI-Help دليل المساعدة جنباً إلى جنب، ويمنحك إجابات فورية ودقيقة مستمدة مباشرةً من دليل المستخدم هذا، لتتمكن من متابعة كل خطوة بسهولة.

دليل المستخدم: يمكنك أيضاً تنزيل دليل المستخدم بالكامل إذا كنت ترغب في تصفح الصفحات.

فيديو تعليمي: وللمساعدة بشكل أكبر، لدينا أيضاً مقاطع فيديو تفصيلية سترشدك خطوة بخطوة.

فكر في أنماط المساعدة الثلاثة باعتبارها مساعدين شخصيين لمحفظةك الاستثمارية - دائماً متاحين، ومتصلين بالإنترنت، يرشدونك خلال إنشاء المحفظة الاستثمارية، وتحسينها، والتداول.





14 الأسئلة الشائعة

PoMaTo ما هي استراتيجيات التحسين المتوفرة على

، نماذج تحسين محفظة على مستوى المؤسسات بما في ذلك تكرار المؤشر، والطويل فقط، والطويل القصير PoMaTo توفر. والمحاييد للسوق - المصممة للتخصيص الفعال، والمخاطر المنخفضة والعوائد المعدلة حسب المخاطر بشكل أفضل.

PoMaTo ما هي فئات الأصول التي يدعمها

محافظ الأصول المتعددة عبر الأسهم وصناديق الاستثمار المتداولة والسندات والعملات الأجنبية والعملات PoMaTo يدعم. المشفرة والسلع لتمكين التنوع الواسع.

PoMaTo هل يتم تنظيم

ليست وسيطًا أو مستشارًا ماليًا مُنظَّمًا. إنها منصة استثمار تعتمد على الذكاء الاصطناعي، تُوفّر أدواتٍ لأبحاث PoMaTo، لا الاستثمار، وتحليل المحافظ الاستثمارية، وتحسينها. يُنفذ العملاء صفقاتهم بأنفسهم عبر وسيط مُنظَّم.

بتنفيذ الصفقات للعملاء؟ PoMaTo هل تقوم

توصيات ومخرجات تحسين مدعومة بالذكاء الاصطناعي؛ حيث يقوم العميل بوضع الطلب مع الوسيط الذي PoMaTo لا. تقدم يختاره.

PoMaTo هل يمكن للمستثمرين الأفراد استخدام

للمبتدئين والمحترفين - مستثمري التجزئة ومديري الثروات ومديري المحافظ - الذين يرغبون في إدارة PoMaTo نعم. صُمم محافظهم الاستثمارية باستخدام الذكاء الاصطناعي مع تحكم كامل.

مختلفًا عن مستشاري الروبوت الآخرين؟ PoMaTo ما الذي يجعل

محسنات قابلة للتخصيص، وتغطية متعددة PoMaTo على عكس المستشارين الآليين الذين يتم ضبطهم ونسيانهم، يقدم الأصول، ونموذج القيمة النسبية الهجين الخاص، والذي يجمع بين الإشارات الأساسية وإشارات التعلم الآلي - دون رسوم الحراسة القسرية أو رسوم الأصول المدارة.

(AI) الذكاء الاصطناعي PoMaTo هل يستخدم

التعلم الآلي ونماذج العوامل وتحليل السيناريوهات لدعم الاستثمار بالذكاء الاصطناعي، وتحديد PoMaTo نعم. يستخدم الفرص، وموازنة المخاطر، ودعم قرارات التخصيص المستندة إلى البيانات.

مع إدارة المخاطر؟ PoMaTo كيف تتعامل

استهداف التقلبات وتحليل الارتباط والتحسين الواعي للسحب لبناء محافظ متنوعة تهدف إلى تحقيق عوائد PoMaTo تطبق أقوى معدلة حسب المخاطر.

المساعدة في التغلب على السوق؟ PoMaTo هل يمكن لـ

ذات الدرجة المؤسسية تهدف إلى تحسين العائدات PoMaTo وفي حين لا تستطيع أي منصة ضمان التفوق في الأداء، فإن نماذج المعدلة حسب المخاطر من خلال تحسين التخصيص وإدارة مخاطر الجانب السلبي.

التكامل مع الوسطاء؟ PoMaTo هل يمكن لـ

التكامل المباشر مع الوسطاء حاليًا. مع ذلك، يُمكنه إنشاء ملف تداول يحتوي على أوامرك بالتنسيق PoMaTo ليس بعد. لا يدعم الصحيح. يمكنك بعد ذلك تحميل هذا الملف إلى منصة وسيطك (يرجى التحقق من تنسيق الملف المُعتمد لدى وسيطك).

العملات المتعددة؟ PoMaTo هل يدعم

نعم. أنشئ وراقب محافظًا متعددة العملات، مع تحسينها وإعداد تقاريرها بالعملة الأساسية التي تفضلها.



ما هي الأسواق التي تغطيها PoMaTo؟

وتغطي التغطية البورصات والأدوات العالمية الرئيسية: الأسهم، وصناديق الاستثمار المتداولة، وأزواج العملات الأجنبية والسندات، والسلع المختارة، المستمدة من بيانات السوق على مستوى المؤسسات

PoMaTo هل بياناتي آمنة على

مع تشفير أثناء النقل وفي حالة السكون، وأمان متعدد الطبقات، وضوابط وصول صارمة؛ ولا AWS على PoMaTo نعم. يعمل تتم مشاركة أي بيانات مالية شخصية دون موافقة

PoMaTo ما هي تكلفة

تسعير اشتراك شفاف بدون رسوم إدارة الأصول أو رسوم الأداء - مما يحافظ على استثمار المزيد من أموالك مقارنة بالمديرين التقليديين

هل يوجد دعم للعملاء؟

نعم. دعم سريع عبر البريد الإلكتروني والدردشة داخل المنصة، بالإضافة إلى قاعدة بيانات معرفية قابلة للبحث ومقاطع فيديو تعليمية

قبل الاشتراك؟ PoMaTo هل يمكنني تجربة

نعم. احصل على نسخة تجريبية مجانية لاستكشاف الميزات ورؤية نتائج التحسين قبل الاشتراك

أو الأخلاقية؟ ESG خيارات الاستثمار PoMaTo هل تقدم

الأخلاقية عبر قوائم ومرشحات مخصصة لمواءمة محافظك الاستثمارية مع قيمك/ESG نعم. طبق معايير

PoMaTo ماذا يرمز

"To" والحرف، Management من كلمة "Ma" والحرف، Portfolio من كلمة "Po" إلى أداة إدارة المحفظة. يتكون من الحرف Tool. من كلمة

؟ يجب إدخال PoMaTo كيف أدخل النسب المئوية بشكل صحيح في

النسب المئوية كأعداد عشرية بين 0 و1. على سبيل المثال، $0.075 = 7.5\%$ ، $0.5 = 50\%$ ، و $1 = 100\%$. تأكد دائمًا من صحة %إدخالها: إدخال 0.5 بدلاً من 0.05 يُغير 5% إلى 50

؟ يشير PoMaTo ما الفرق بين الفوركس والفوركس في

الفوركس إلى أرصدة نقدية متعددة العملات تُستخدم لتسوية الصفقات (ولا تُعتبر استثمارات). أما الفوركس، فيشير إلى مراكز PoMaTo ويُعامل كأصل في (USD_EUR مثل) استثمارية مدروسة في أزواج العملات

كيف أتعامل مع توزيعات الأرباح أو القسائم أو إجراءات الشركات؟ تُعالج

توزيعات الأرباح والقسائم تلقائيًا في تاريخ الاستحقاق. قد تتطلب إجراءات الشركات الأخرى (إصدارات الحقوق، تقسيم الأسهم عمليات الفصل) إدخالًا يدويًا. في حال عدم وجود توزيع أرباح أو قسيمة بسبب قيود البيانات، يُمكنك إضافتها يدويًا ضمن "إجراءات النقد"

ماذا يحدث إذا تعارضت القيود أثناء التحسين؟

إذا كانت القيود متعارضة (على سبيل المثال، تحديد الحد الأدنى للأسواق الناشئة ١٠٪ والحد الأقصى ٥٪)، فلن يتمكن المُحسِّن من إنشاء محفظة استثمارية. راجع القيود النشطة وبسّطها قبل إجراء التحسين

PoMaTo كيف يمكنني تحميل صفقات وسيطي إلى

باستخدام القوالب المتوفرة في قسم التداول. كما يمكنك إدخال الصفقات يدويًا CSV يمكنك استيراد الصفقات عبر تحميل ملف واحدة تلو الأخرى عند الحاجة

PoMaTo هل يمكنني التداول مباشرة من

حاليًا، يُمكن تصدير الصفقات بصيغ متوافقة مع الوسطاء للتحميل. يجري تطوير خاصية التنفيذ المباشر عبر الوسطاء، وستكون متاحة من خلال التكامل مع المنصات



التداول بالسلة؟ PoMaTo هل يدعم

نعم. يمكن تنفيذ عدة صفقات أو تسجيلها دفعةً واحدة، خاصةً عند تطبيق نتائج المُحسّن أو إعادة توازن المحافظ.

؟ يحسب (VaR) قيمة المخاطر PoMaTo كيف يحسب

T-Dist قيمة المخاطر في ظل ثلاثة سيناريوهات إحصائية: الوضع الطبيعي (ظروف السوق النموذجية)، وتوزيع PoMaTo (توزيع ذو ذيل سميك)، وكوشي (أحداث متطرفة). يمكن للمستخدمين تحديد مستوى الثقة ومقارنة المحافظ الحالية بالمحافظ المُحسّنة.

؟ توفر PoMaTo ما هي إحصاءات المخاطر المتاحة في

المنصة التقلبات المتوقعة والمحقة، وتقلبات المعيار، وخطأ التتبع، وأقصى انخفاض (وأيام التعافي)، ونسبة شارب، ونسبة المعلومات.

؟ (RVEM) ما هو نموذج القيمة النسبية للأسهم

يجمع بين التحليل الأساسي التصاعدي للأسهم وإشارات كمية منهجية. يحدد PoMaTo، هو نموذج أسهم خاص بشركة RVEM هذا النموذج الأسهم ذات التسعير الخاطئ مع إدارة المخاطر، مما يمنح المحافظ مصدرًا إضافيًا لعائدات ألفا المحتملة.

؟ عادةً ما تُعاد موازنة محافظ RVEM ما مدى تكرار إعادة توازن محافظ

ربع سنويًا بما يتماشى مع دورات الأرباح، ولكن يُمكن للمستخدمين اختيار إعادة التوازن بوتيرة أعلى إذا رغبوا في ذلك RVEM.

على بياناتها؟ تجمع PoMaTo من أين تحصل

ومعرفات، Yahoo وGoogle Finance ومعرفات، ISIN البيانات من مصادر عامة متعددة، بما في ذلك أرقام PoMaTo داخلية مصممة لتتبع المؤشرات الرئيسية CADI و CAMI كما توفر معايير Bloomberg/Reuters. اصطلاحية شبيهة بمعرفات عن كُتب.

هل بيانات محفظتي الاستثمارية خاصة وآمنة؟

ويستخدم تشفيرًا معياريًا في هذا المجال وضوابط وصول صارمة. أنت فقط من يستطيع AWS مُستضاف على PoMaTo. نعم الوصول إلى بيانات محفظتك الاستثمارية.

هل يُمكن للاستثمار في الذكاء الاصطناعي أن يتفوق على السوق حقًا؟

لا توجد منصة تضمن التفوق. يُعزز الذكاء الاصطناعي والتعلم الآلي التنوع الاستثماري، والتحكم في المخاطر، واكتشاف الفرص على تحسين العوائد المُعدّلة حسب المخاطر، ولا يُعيد بـ"التفوق على PoMaTo لكن النتائج تعتمد على ظروف السوق. يُركز "السوق".

؟ Wealthfront أو Betterment مع PoMaTo كيف يُقارن

فئات أصول متعددة (الأسهم، السندات، صناديق PoMaTo بخلاف المستشارين الآليين المُركّزين على الولايات المتحدة، يدعم الاستثمار المتداول، العملات الأجنبية، السلع، العملات المشفرة) ومُحسّنات مُصممة خصيصًا للمؤسسات (البيع فقط، البيع الخاص وتكاملاً مع الوسطاء للتداول RVEM على المكشوف، الحياض السوقي، المؤشرات). كما يتضمن نموذج

أم أنه مخصص للمحترفين فقط؟ PoMaTo هل يمكن للمبتدئين استخدام

كلاهما. يمكن للمبتدئين البدء بمحافظ نماذج بسيطة، بينما يمكن للمحترفين الاستفادة من أدوات التحسين والقيود والتحليلات المتقدمة.

؟ لا PoMaTo ما هو الحد الأدنى لحجم الاستثمار في

يوجد حد أدنى صارم للمنصة. يعتمد الحد الأدنى العملي على قواعد تداول الوسيط ومستوى التنوع الذي ترغب في تحقيقه.

بلغات وعملات متعددة؟ PoMaTo هل يعمل

نعم. يمكن تقييم المحافظ بعملات أساسية مختلفة، مع إمكانية الاحتفاظ بخطوط نقدية متعددة العملات. كما يجري حاليًا توسيع واجهة المستخدم متعددة اللغات.

ما هي الرسوم التي أتوقعها بالإضافة إلى الاشتراك؟ يغطي

اشتراكك استخدام المنصة. قد تشمل التكاليف الإضافية عمولات الوسيط، وفروق أسعار العرض والطلب، ورسوم تحويل PoMaTo العملات الأجنبية، ورسوم الحفظ، وذلك حسب وسيطك - وهذا بالطبع خارج نطاق استخدام



PoMaTo؟ س: ما هي لغات وتقنيات البرمجة المستخدمة في منظومة

على مجموعة تقنيات قوية ومتنوعة تجمع بين أدوات مؤسسية مجربة ومختبرة ومكتبات تعلّم آلي حديثة PoMaTo تعتمد

- يستخدم للتكامل القديم والنمذجة المالية السريعة – **VBA**
- تعزيز إدارة البيانات المنظمة وتنفيذ الاستعلامات عالية السرعة - **(T-SQL) المخزنة SQL إجراءات**
- والذي يستفيد من مجموعة واسعة، PoMaTo، العمود الفقري لمحرك الذكاء الاصطناعي والتحسين في **Python** -
من المكتبات بما في ذلك
 - الحسابات العددية والمصفوفية – **NumPy**
 - تحليل علمي وإحصائي متقدم – **SciPy**
 - التحسين المحدب لاستراتيجيات المحفظة – **CVXOPT**
 - نماذج التعلم الآلي للتنبؤ والتصنيف – **scikit-learn**
 - وقواعد البيانات Windows الاتصال والتكامل مع **ODBC** و **pywin**

PoMaTo؟ س: ما هي مصادر البيانات الرئيسية المستخدمة في

البيانات ويعالجها من مصادر موثوقة متعددة عبر فئات الأصول لضمان دقتها وشموليتها PoMaTo يجمع

- متعددة مجانية وبورصات الأوراق المالية Python الأسهم - واجهات برمجة تطبيقات
- المجانية لبيانات العملات في الوقت Python العديد من واجهات برمجة التطبيقات - **(FX) صرف العملات الأجنبية** الفعلي.
- السندات - مصادر تبادل عالمية متعددة
- لتسعير العملات المشفرة الشامل والبيانات الوصفية CoinGecko **العملات المشفرة** - واجهة برمجة تطبيقات
- السلع الأساسية - مصادر البيانات القائمة على التبادل للأسواق الرئيسية
- صناديق الاستثمار المتداولة - التغطية عبر بورصات متعددة



PoMaTo 15 قارن

المستثمرين PoMaTo يُقارن هذا الدليل بين أبرز مستشاري الروبوتات باستخدام معلومات متاحة للامة. ويشرح لماذا يُناسب الذين يسعون إلى تحسين محافظهم الاستثمارية متعددة الأصول، بالاعتماد على الذكاء الاصطناعي، في الأسهم والسندات والعملات الأجنبية والسلع وصناديق الاستثمار المتداولة والعملات المشفرة.

بوماتو.

thepomato.com: موقع إلكتروني

- فئات الأصول: الأسهم، السندات، العملات الأجنبية، السلع، صناديق الاستثمار المتداولة، العملات المشفرة.
- (RVEM) مُحسّنات الذكاء الاصطناعي: طويل فقط، طويل قصير، محايد السوق، ونموذج القيمة النسبية الهجين.
- التنفيذ: تصدير ملفات التجارة.
- الشفافية: مبررات واضحة للتحسين وبيانات المحفظة.
- السرعة والموثوقية والحجم AWS البنية التحتية: سحابية أصلية على.

مستشار فانغارد الرقمي

- Vanguard التركيز: التخطيط منخفض التكلفة والمبني على الأهداف باستخدام صناديق المؤشرات.
- (رقي مستشار Vanguard): انظر الممتلكات النموذجية: محافظ صناديق الاستثمار المتداولة المتنوعة.
- المميزات: إعادة التوازن التلقائي، وأدوات التقاعد والتدفق النقدي.

ويلث فرونت

- الميزات: الاستثمار الآلي، وحصاد الخسائر الضريبية؛ والفهرسة المباشرة الاختيارية على مستويات معينة (انظر Wealthfront).
- الممتلكات النموذجية: صناديق الاستثمار المتداولة المتنوعة؛ بعض خيارات التخصيص.
- التخطيط: تحديد الأهداف والتوصيات بشكل آلي.

تحسين

- (Betterment): انظر التركيز: محافظ صناديق الاستثمار المتداولة المتنوعة مع أدوات تعتمد على الأهداف.
- الميزات: إعادة التوازن التلقائية وحصاد الخسائر الضريبية على الحسابات المؤهلة.
- الخدمات المصرفية: خيارات الدفع النقدي/الشيكاك.

محافظ شواب الذكية

- (ذكي المحافظ الاستثمارية Schwab): انظر رسوم الاستشارة الرقمية : 0 دولار؛ قد تتضمن المحافظ تخصيصًا نقديًا.
- الممتلكات النموذجية: صناديق الاستثمار المتداولة المتنوعة عبر عدة فئات من الأصول.



- المميزات: إعادة التوازن التلقائي، وتخطيط الأهداف

فيديليتي جو

- ([يذهب Fidelity](#): انظر) التسعير: رسوم استشارية متدرجة حسب الرصيد
- اعتمادًا على Fidelity الممتلكات النموذجية: صناديق الاستثمار المشتركة/صناديق الاستثمار المتداولة التابعة لشركة تصميم البرنامج.
- البيئي Fidelity الميزات: محافظ آلية ضمن نظام

مقارنة الميزات (2025)

فيديليتي جو	محافظ شواب الذكية	تحسين	ويلث فرونت	مستشار فاتنارد الرقمي	بوماتو	ميزة
المحافظ الآلية في نظام Fidelity البيئي مصدر	محافظ صناديق الاستثمار المتداولة الآلية؛ تتضمن تخصيص النقد مصدر	محافظ صناديق الاستثمار المتداولة الآلية؛ أدوات التخطيط مصدر	المحافظ الآلية؛ أدوات ضريبية؛ فهرسة مباشرة اختيارية مصدر	التخطيط الميني على الأهداف مع صناديق المؤشرات مصدر	التحسين القائم على الذكاء الاصطناعي؛ الاستراتيجيات ذات الطابع المؤسسي	النهج الأساسي
يعتمد على البرنامج (الصناديق/صناديق الاستثمار المتداولة)	صناديق الاستثمار المتداولة في المقام الأول	صناديق الاستثمار المتداولة في المقام الأول	صناديق الاستثمار المتداولة في المقام الأول	صناديق الاستثمار المتداولة في المقام الأول	الأسهم، السندات، العملات الأجنبية، السلع، صناديق الاستثمار المتداولة، العملات المشفرة	فئات الأصول
لم يتم الإعلان عنها	لم يتم الإعلان عنها	لم يتم الإعلان عنها	الفهرسة المباشرة (مستويات معينة)	لم يتم الإعلان عنها	طويل فقط، طويل، قصير، محايد للسوق RVEM	استراتيجيات متقدمة
ضمن برنامج فيديليتي	ضمن برنامج شواب	ضمن برنامج التحسين	ضمن برنامج Wealthfront	ضمن برنامج فانجارد	تصدير ملفات التداول الجاهزة للوسيط؛ التخطيط لعمليات التكامل المباشر مع واجهة برمجة التطبيقات	تنفيذ التجارة
بيع بالتجزئة	بيع بالتجزئة	بيع بالتجزئة	بيع بالتجزئة	بيع بالتجزئة	من التجزئة إلى المحترفين (بما في ذلك / مديري الثروات (الصناديق))	جمهور

إشعار الامتثال والإعلانات المقارنة: تقدم هذه الصفحة مقارنة قائمة على الميزات باستخدام معلومات متاحة للعامة من موقع، كل مزود، وهي سارية اعتبارًا من أغسطس 2025. العلامات التجارية وأسماء العلامات التجارية مملوكة لأصحابها المعنيين وتُستخدم هنا فقط للتعريف والمقارنة. لا يُقصد بذلك أي تأييد. العروض قابلة للتغيير - يُرجى التحقق من التفاصيل مباشرةً مع كل مزود. هذه ليست نصيحة مالية شخصية.