

يوم في حياة المتداول الآلي

دورة العمل اليومية للمحفظة الاستثمارية المدارة
بالخوارزميات تحت الإشراف البشري

دليل تعريفي مبسط

English / عربي

A Day in the Life

يوم في حياة المتداول الآلي

Most investors end their day when the market closes. The Algorithmic Trader begins its day there. This guide walks through the daily cycle inside the portfolio, step by step – and why it is designed this way.

Data Ingestion

Updated market and price data is received and prepared for processing. No headlines, no impressions – structured data entering the system in one consistent format, every day.

Running the Models

Both algorithm families work on the fresh data: prediction bots – multiple independent machine-learning models producing probabilistic outputs on stock direction, alongside a classifier reading the overall market regime; and technical-analysis bots – hunting for stocks trading at a discount to their long-term averages, per the mean-reversion strategy.

Sindbad Trading Model Supervision and Oversight Framework

The trading model and its associated programs and strategies have been pre-approved, together with the relevant controls and criteria, with Alkhabeer Capital responsible for ongoing oversight, supervision, and monitoring. The Company does not directly intervene in routine trading activities; its intervention is limited to exceptional or emergency circumstances, or where there is a breach of the approved risk limits, controls, or criteria that warrants appropriate action.

This approach is intended to ensure that trading decisions are executed through the approved Sindbad model, while the Company retains its oversight and supervisory role, thereby achieving an appropriate balance between execution autonomy and compliance with the approved frameworks and controls.

Disciplined Automated Execution

Approved orders execute automatically through Alkhabeer Capital's brokerage, under strict controls: a per-stock allocation cap, a configurable fraction of capital per trade, higher allocation to high-confidence signals, and concentration and liquidity checks before and throughout every position.

Event-Driven Exits

The portfolio doesn't wait for quarter-end to review itself. Positions close when the event happens: a profit target is reached, the allotted time expires for a position whose thesis hasn't materialised, or the models detect a reversal signal – with realised profits compounded annually.

Layers of Oversight

Valuation is quarterly, a Shari'a audit of the portfolio's transactions runs once a year by the Shari'a audit team, and all data sits on a licensed cloud platform inside Saudi Arabia.

What does this mean for you as an investor? No emotion: rules are written before the market moves. No absent humans: every recommendation passes a licensed portfolio manager. Exit discipline: every position has an exit plan before it opens. Honest boundaries: risk level is High, and the objective is to "seek" to outperform the Tadawul index – no guarantee.

أغلب المستثمرين ينهون يومهم عند إغلاق السوق. المتداول الآلي يبدأ يومه هناك. هذا الدليل يشرح – خطوة بخطوة – كيف تمر الدورة اليومية داخل المحفظة. ولماذا صُممت بهذا الشكل.

استقبال البيانات

تُستقبل بيانات السوق والأسعار المحدثّة وتُجهّز للمعالجة. لا عناوين أخبار ولا انطباعات – بيانات منظمة تدخل إلى المنظومة بصيغة واحدة متسقة كل يوم.

تشغيل النماذج

تعمل مجموعتنا الخوارزمية على البيانات الجديدة: روبوتات التنبؤ – عدة نماذج تعلم آلي مستقلة تُنتج مخرجات احتمالية لاتجاه الأسهم، ومعهما مصنّف يقرأ حالة السوق العامة؛ وروبوتات التحليل الفني – تبحث عن أسهم تتداول بخضم عن متوسطاتها طويلة الأجل وفق استراتيجية العودة إلى المتوسط.

إطار الإشراف والرقابة على نموذج "سندباد" للتداول

تمت الموافقة مسبقاً على نموذج التداول والبرامج والاستراتيجيات المرتبطة به، إلى جانب اعتماد الضوابط والمعايير ذات الصلة، مع تولي شركة "الخبير المالية" مهام الإشراف والرقابة والمتابعة المستمرة. ولا تتدخل الشركة بصورة مباشرة في عمليات التداول الاعتيادية، ويقتصر تدخلها على الحالات الاستثنائية أو الطارئة، أو عند حدوث تجاوز لحدود المخاطر أو الضوابط والمعايير المعتمدة بما يستدعي اتخاذ الإجراءات المناسبة.

ويهدف هذا النهج إلى ضمان تنفيذ قرارات التداول من خلال نموذج "سندباد" المعتمد، مع احتفاظ الشركة بدورها الرقابي والإشرافي؛ بما يحقق التوازن بين استقلالية التنفيذ والالتزام بالأطر والضوابط المعتمدة.

تنفيذ آلي منضبط

الأوامر المعتمدة تُنفَّذ آلياً عبر وساطة "الخبير المالية"، وفق ضوابط صارمة: حد أقصى للتخصيص لكل سهم، نسبة قابلة للتهئية من رأس المال لكل صفقة، تخصيص أعلى للإشارات عالية الثقة، وفحوص للتركز والسيولة قبل كل مركز وأثناءه.

الخروج مدفوع بالأحداث

لا تنتظر المحفظة «نهاية الربح» لتراجع نفسها. المراكز تُغلق عندما يقع الحدث: بلوغ مستهدف الربح، أو انتهاء المدة المقررة لمركز لم تتحقق فرضيته، أو رصد النماذج إشارة انعكاس في الاتجاه – وتُحوّل الأرباح المحققة سنوياً.

طبقات الرقابة

التقييم كل ثلاثة أشهر، والتدقيق الشرعي لمعاملات المحفظة مرة واحدة في السنة من فريق التدقيق الشرعي، والبيانات كلها على منصة سحابية مرخصة داخل المملكة.

ماذا يعني هذا لك كمستثمر؟ لا انفعال: القواعد تُكتب قبل أن يتحرك السوق. لا غياب للبشر: كل توصية تمر على مدير محفظة مرخص. انضباط في الخروج: لكل مركز خطة خروج قبل أن يُفتح. وشفافية في الحدود: مستوى المخاطر مرتفع، والهدف «السعي» للتفوق على مؤشر تداول – لا ضمان.

Notice: This guide is a simplified introduction and does not substitute for reading the full terms and conditions of the discretionary portfolio management agreement and its annexes. This document is not an offer, invitation, or investment recommendation, and does not constitute investment advice. Every investor should obtain independent professional advice before making any investment decision.

تنبيه: هذا الدليل تعريف ميسر ولا يُغني عن قراءة الشروط والأحكام الكاملة لاتفاقية إدارة المحفظة بالوكالة وملاحقها. لا يُعد هذا المستند عرضاً أو دعوة أو توصية بالاستثمار، ولا يشكل مشورة استثمارية. على كل مستثمر الحصول على المشورة المهنية المستقلة قبل اتخاذ أي قرار استثماري.