

قائمة مصطلحات سوق الأوراق المالية

مؤشر جميع الأسهم (ALSI)

مؤشر تم تصميمه ليعكس حركة سوق الأسهم.

المراجعة

شراء وبيع نفس الأوراق المالية في أسواق مختلفة وبأسعار مختلفة بهدف تحقيق الربح والاستفادة من الفروقات في الأسعار الآتية.

سعر الطلب

السعر الذي يرغب فيه المتداول لبيع الورقة المالية.

الأوراق المالية المتاحة

الأوراق المالية المتاحة لتنفيذ المعاملات والتي تتضمن الأوراق المالية التي تم شراؤها ولكن لم تتم تسويتها لحساب العميل.

سوق انخفاضية

عندما يكون السوق ككل في اتجاه هبوطي يتمثل في انخفاض الأسعار.

سعر العرض

السعر الذي يرغب المتداول في دفعه مقابل سهم معين.

نموذج 2 لألية التسليم مقابل الدفع الخاص بينك التسويات الدولية

آلية التسليم مقابل الدفع لتسوية الصفقات، حيث يتم التحويل النهائي للأوراق المالية من البائع إلى المشتري (التسليم)، على أساس إجمالي (كل صفقة على حدة)، ولكن التحويل النهائي للمقابل المالي من المشتري إلى البائع (الدفع) يتم على أساس صافي القيمة.

أسهم الشركات الكبرى

سهم الشركات الصناعية الكبرى الرائدة والتي تمتلك سجل ثابت من توزيعات الأرباح، وتتمتع إدارتها المالية بسمعة سليمة.

وكيل الاقتراض

عضو أمين الحفظ المعين من قبل المقرض لإجراء المعاملات.

سوق صاعدة

عندما تكون الأسعار في السوق مرتفعة لفترة طويلة.

متطلب التمويل النقدي المسبق

نظام التداول الذي يلزم مشتري الأوراق المالية بالإيداع المسبق للنقد قبل التداول.

إيداع الأوراق المالية المركزية (CSD)

مؤسسة مالية متخصصة تحتفظ بأوراق مالية إما بشكل مئوق أو غير مئوق، بحيث يمكن نقل الملكية من خلال القيد الدفترية بدلاً من التحويل الفعلي للشهادات.

المقاصة

جميع الأنشطة المتعلقة بالأوراق المالية التي يتم تداولها من اللحظة التي يتم فيها الالتزام فيما يتعلق بالمعاملة وحتى لحظة تسويتها.

سعر الإغلاق - طريقة الحجم المتوسط المرجح

VWAP هو متوسط يتم حسابه عن طريق أخذ قيمة جميع التداولات في آخر 15 دقيقة قبل إغلاق السوق مقسومًا على إجمالي الأسهم المتداولة للشركة. في حالة عدم حدوث أي تداولات خلال آخر 15 دقيقة، سيكون سعر الإغلاق هو آخر سعر عادي (يتم تداوله فوق 15000 ريال سعودي) قبل آخر 15 دقيقة.

سعر الإغلاق - طريقة المزاد

في هذه الطريقة، يتم تحديد سعر الإغلاق من خلال مزاد يتم حتى 10 دقائق بعد إغلاق التداول العادي. يتم تحديد سعر التوازن خلال المزاد الختامي على التداولات العادية (تداول أكثر من 15000 ريال سعودي). إذا لم تكن هناك صفقات عادية خلال المزاد يصبح المزاد الأخير هو آخر سعر تداول. إذا لم تكن هناك عمليات تداول خلال اليوم، يصبح سعر الإغلاق هو سعر إغلاق اليوم السابق.

أمين الحفظ

مؤسسة مالية تحتفظ بالأوراق المالية للعملاء بهدف الحماية وذلك لتقليل مخاطر سرقتهم أو الخسارة. يمكن أن يكون أيضًا عضو مقاصة للبنوك، والشركات، والمستثمرين الأجانب، والمستثمرين من المؤسسات، ويقومون بتسوية ومقاصة الأوراق المالية من خلال نقل مليكة هذه الأوراق بين البائع والمشتري.

نظام الإيداع

نظام تكنولوجيا المعلومات يستخدم من قبل أسواق الأوراق المالية لتسهيل وظائف المقاصة والتسوية والحفظ والتسجيل.

المشتقات

أداة مالية متداولة في السوق تستمد قيمتها من قيمة أداة مالية أخرى، مثل مؤشر الأسهم وأسعار الفائدة أو مؤشرات السلع.

التسليم مقابل الدفع

آلية تسوية تربط بين نقل الأوراق المالية وتحويل الأموال، بحيث لا يتم نقل الأوراق المالية إلا بعد الدفع.

عضو البورصة

عضو في بورصة تقدم خدمات التداول للمستثمرين.

صناديق الاستثمار المتداولة (ETF)

صندوق مكون من محفظة أسهم تعكس تكوين المؤشر، ويكون مدرج في بورصة معترف بها ويتم تداوله مثل الأوراق المالية العادية.

صناديق المنتجات المتداولة الاستثمارية (ETP)

الأوراق المالية المتداولة في البورصة، والتي تستمد قيمتها من الأدوات الأساسية مثل السلع أو العملات أو أسعار الأسهم أو أسعار الفائدة.

وسيط التنفيذ

عضو البورصة الذي يقدم خدمات التداول في الأوراق المالية المودعة، والتي يتم توفير خدمات الحفظ لها من قبل عضو أمين الحفظ المستقل.

فشل الصفقة

يحدث هذا عندما لا يقوم البائع بتسليم الأوراق المالية أو أن المشتري لا يقوم بالدفع بحلول تاريخ التسوية.

العقد الأجل

يشبه العقد المستقبلي إلا أنه يتم التفاوض عليه بشكل خاص.

التعويم الحر

نسبة الأسهم المطروحة للعامة من قبل الشركة المدرجة في البورصة.

العقود المستقبلية

اتفاقية تعاقدية لشراء أو بيع سلعة معينة أو أداة مالية معينة بسعر محدد مسبقاً في المستقبل.

معياري تصنيف الصناعة العالمي (GICS)

نظام تصنيف معياري للأسهم تم تطويره بشكل مشترك بواسطة "مورغان ستانلي كابيتال" (MSCI) و "ستاندرد أند بورز".

التحوط

أداة مشتقة لحماية الاستثمار من التغيرات غير المواتية في القيمة.

عضو أمين الحفظ المستقل

عضو أمين حفظ يقدم خدمات الحفظ بعد أن يقوم الوسيط التنفيذي بتقديم خدمات التداول.

المؤشر

محفظة محاكاة للأوراق المالية تمثل سوقاً أو جزءاً من هذا السوق.

التداول بناء على معلومات داخلية

بيع وشراء الأوراق المالية بالاعتماد على معلومات غير عامة تتعلق بهذه الأوراق المالية.

المخزون

رصيد الأوراق المالية لحساب المستثمر خلال من التعهد وغيره من القيود.

وكيل الإفراض

عضو أمين حفظ يتم تعيينه من قبل المقرض من أجل إجراء المعاملات الخاصة باقتراض وإفراض الأوراق المالية.

الأمر محدد السعر

طلب شراء وبيع الأسهم بسعر محدد. سيؤدي ذلك إلى تحديد الحد الأقصى للسعر الذي يرغب العميل في دفعه كمشتري والحد الأدنى للسعر الذي يرغب في قبوله كبائع.

السيولة

مدى سهولة شراء الأوراق المالية أو بيعها في السوق. تعد الأوراق المالية أكثر سيولة في حال توافر وحدات متاحة منها لإجراء المعاملات الكبيرة بدون تغييرات كبيرة أو جوهرياً بالسعر.

مخاطر السيولة

الخطر الناتج عن صعوبة شراء أو بيع ورقة مالية.

فشل السداد

عندما لا يستطيع المشتري سداد قيمة الأوراق المالية خلال فترة محددة.

هامش الوقاية

في سياق تداول الهامش، يمثل هامش الوقاية الحد الأدنى لحقوق الملكية الذي يجب الاحتفاظ به في حساب الهامش. حيث تعد حقوق الملكية القيمة الإجمالية للأوراق المالية مطروكاً منها ما تم اقتراضه من شركة الوساطة.

حساب الهامش

يسمح حساب الهامش للشخص أن يقرض المال من وسيط لشراء الأوراق المالية. سوف يقوم العميل بإيداع الأموال في حساب الهامش وسيقوم الوسيط بإفراضه أموال إضافية بحيث يمكن استخدام الإجمالي لشراء الأسهم. قد يكون هذا مفيداً للعميل إذا ارتفع سعر السهم. ومع ذلك، إذا انخفض السعر، يمكن أن يطلب الوسيط من العميل إيداع أموال إضافية في غضون فترة قصيرة أو بيع جزء من الأسهم لتعويض كل أو جزء من الفرق بين قيمة الأوراق المالية وهامش الوقاية.

إساءة استخدام السوق

انتهاكات قانون الأوراق المالية بما في ذلك التداول من الداخل، والتلاعب في السوق أو غسل الأموال.

صانع السوق

عضو شركة في البورصة والذي يقوم بشراء وبيع الأوراق المالية لحسابه الخاص (التداولات الرئيسية) ولحسابات العملاء (تداولات الوكالة) والذي يروج على توفير السيولة في السوق.

عضو

شخص أو مؤسسة لها الحق في المتاجرة بالأوراق المالية في بورصة نيابة عن المستثمرين.

الخيار

الحق (ولكن ليس الالتزام) في الشراء (عقد خيار الشراء) أو البيع (عقد خيار البيع) كمية معينة من الأسهم أو السلعة أو العملة أو المؤشر أو الدين بسعر محدد (سعر التنفيذ) خلال فترة محددة من الزمن.

عقود الخيارات

أداة مالية مشتقة تمثل عقدًا بواسطة كاتب الخيار لصاحب الخيار.

وضع الطلب

إذا لم يتم رفض الطلب في مرحلة ما قبل الطلب، فسيتم وضعه في دفتر الطلبات.

السوق غير المنظمة

ورقة مالية يتم تداولها في بعض السياقات (مفاوضات بين طرفين) بخلاف التداول الرسمي، مثل شبكة وكلاء.

القيمة الاسمية

القيمة الاسمية المعينة للورقة من قبل المصدر.

التداول قبل افتتاح السوق

يتم التداول قبل ساعات التداول العادية.

التحقيقات قبل الطلب

تحقق أحد أعضاء البورصة قبل إرسال طلب إلى نظام التداول.

التداول بعد السوق

يتم التداول بعد ساعات التداول العادية.

الملحقات

إعادة التوازن

عملية إعادة تنظيم موازنة مجموعة الأصول، عن طريق البيع والشراء، للحفاظ على المستوى المرغوب فيه من تخصيص الأصول. وغالباً ما يتم ذلك على أساس ربع سنوي.

مركز إيداع الأوراق المالية (SDC)

كيان يقوم بوظائف التسجيل، ووظائف الحفظ، والتسوية المالية، والمعاوضة النقدية.

إقراض واقتراض الأوراق المالية (SBL)

فرض مضمون من الأوراق المالية من طرف واحد (المقرض) من المعاملة إلى طرف آخر (المقترض).

الأوراق المالية المعلقة

الأوراق المالية المشتراة من قبل المستثمر ولكن لم تتم تسويتها بعد.

الأوراق المالية في انتظار التسوية

الأوراق المالية المباعة من قبل المستثمر ولكن لم تتم تسويتها بعد.

فشل التسوية

يحدث هذا إذا كان عضو البورصة غير قادر على توفير الأوراق المالية اللازمة.

عضو التسوية

بنك يرشحه عضو الحفظ لتسهيل التسوية النقدية له.

سجل المساهمين

قائمة المساهمين في الشركة المحدثة على أساس مستمر. يتضمن السجل اسم كل شخص وعنوانه وعدد الأسهم المملوكة.

البيع على المكشوف

الممارسة التي تنطوي على استعارة الأسهم وإعادتها لاحقاً. يتم ذلك عادة عندما يُعتقد أن سعر السهم سينخفض، بحيث يمكن للمقترض أن يحقق ربحاً عن طريق بيع الأسهم بسعرها الحالي وإعادتها بسعر أقل.

الهامش

الفرق بين أسعار العرض والطلب للسهم؛ ويتمثل في الفرق بين سعر البيع الذي يرغب به البائع وسعر الشراء الذي يرغب المشتري في دفعه.

تنفيذ الصفقات التجارية

يتم تنفيذ الصفقة عندما يتطابق طلب مع طلب آخر.

تقلب الأسعار

تقلبات سعر السهم أو السوق ككل.