

هدف الصندوق

إن صندوق التداول المعزز بالخوارزميات للأسهم السعودية فئة ب هو صندوق أسهم مفتوح يهدف لتحقيق نمو على المدى المتوسط إلى الطويل يفوق المؤشر الاستراتيجي عن طريق الاستثمار في الأسهم المدرجة في سوق الأسهم السعودي والمتوافقة مع الشريعة الإسلامية.

بيانات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	2025/12/18
سعر الوحدة عند الطرح	10 ريال سعودي
حجم الصندوق (بالمليون)	11,666,800.09 ريال سعودي
نوع الصندوق	صندوق مفتوح متوافق مع أحكام الشريعة الإسلامية.
عملة الصندوق	ريال سعودي
مستوى المخاطر	مرتفعة
المؤشر الاستراتيجي	S&P Saudi Arabia Shariah Domestic Total Return Index
عدد مرات التوزيع	لا يوجد
نسبة رسوم الإدارة للصناديق المستثمر بها	1.75% في السنة - من صافي أصول الصندوق شامل الضريبة.
مستشار الاستثمار ومدبر الصندوق من الباطن	لا يوجد
عدد أيام المتوسط المرجح	لا يوجد

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100%
حق منفعة	لا يوجد

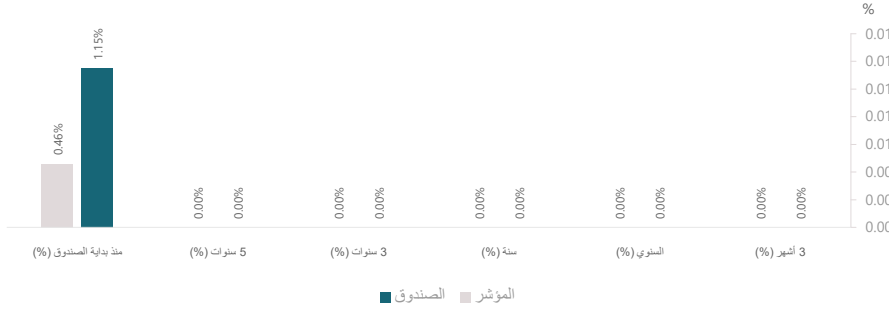
تعريفات ومعادلات

الانحراف المعياري	يقيس مدى تشتت العوائد بالنسبة لمتوسطها، مما يعكس درجة تقلب العوائد	$\sigma = \sqrt{\frac{\sum(R_i - \bar{R})^2}{N-1}}$
مؤشر شارب	مقياس أداء معدل المخاطر يوضح مقدار العائد الإضافي للصندوق فوق معدل العائد الخالي من المخاطر، مقارنة بتقلبات الصندوق	$SR = \frac{R_p - R_f}{\sigma_p}$
خطأ التتبع	هو الفرق بين عوائد الصندوق وعوائد المؤشر المعياري	$TE = \sqrt{\frac{\sum(R_{p,t} - R_{b,t})^2}{N-1}}$
بيتا	مقياس تذبذب الصندوق بالمؤشر المعياري مقارنة	$\beta = \frac{Cov(R_p, R_b)}{Var(R_b)}$
ألفا	تمثل العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر المعياري، مما يعكس القيمة المضافة من الإدارة النشطة	$\alpha = R_p - [R_f + \beta(R_b - R_f)]$
مؤشر المعلومات	مقياس معدل المخاطر يقارن العوائد النشطة للصندوق بالنسبة إلى عوائد المؤشر المعياري، مقارنة بتقلبات تلك العوائد	$IR = \frac{R_p - R_b}{TE}$

حيث:

Rp	أداء الصندوق
Rb	أداء مؤشر القياس
Rf	معدل الخلو من المخاطر
σp	الانحراف المعياري لعوائد الصندوق
TE	خطأ التتبع
N	عدد العينات

الأداء	3 أشهر (%)	السنوي (%)	سنة (%)	3 سنوات (%)	5 سنوات (%)	منذ بداية الصندوق (%)
أداء الصندوق	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	1.15
أداء المؤشر الاستراتيجي	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	0.46
فارق الأداء	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	0.68



معايير الأداء و المخاطر

معايير الأداء و المخاطر	3 أشهر	السنوي	سنة	3 سنوات	5 سنوات
الانحراف المعياري	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد
مؤشر شارب	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد
خطأ التتبع	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد
بيتا	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد
ألفا	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد
مؤشر المعلومات	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد

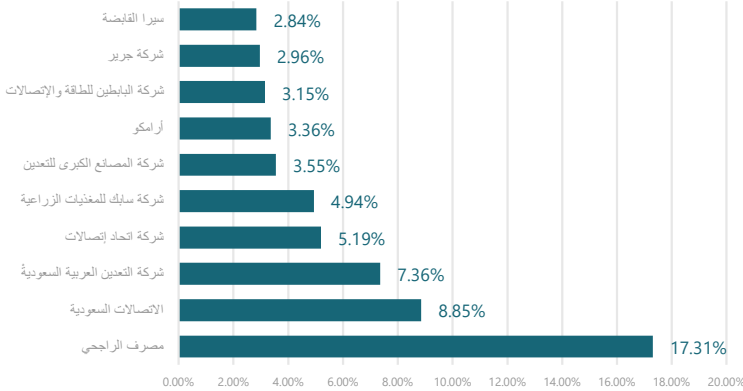
معلومات الأسعار

سعر الوحدة	10.1147 ريال سعودي
التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالربع السابق)	لا يوجد
سعر الوحدة المزدوج لصناديق أسواق النقد، وصناديق أدوات الدين ذات الدخل الثابت	لا يوجد
أجمالي وحدات الصندوق	1,152,224.51
إجمالي صافي الأصول	11,654,402.55 ريال سعودي
مكرر الربحية (P/E)	21.39

معلومات الصندوق

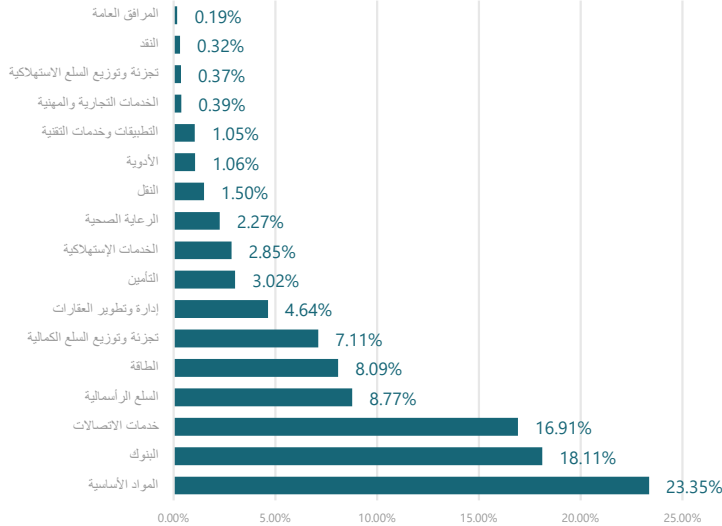
نسبة الأتعاب الإجمالية من متوسط صافي الأصول (%)	0.41%
قيمة الأتعاب الإجمالية	10,395.55
نسبة الاقتراض من القيمة الاجمالية لأصول الصندوق (%)	0.00%
مصاريف التعامل	4,054.96 ريال سعودي
نسبة مصاريف التعامل من متوسط صافي الأصول (%)	0.16%
مبلغ استثمارات مدير الصندوق من صافي الأصول	0.00
نسبة استثمارات مدير الصندوق من صافي الأصول (%)	0.00%
إجمالي الأرباح الموزعة في الربع المعني	لا يوجد
عدد الوحدات القائمة التي تم التوزيع لها خلال الربع المعني	لا يوجد
قيمة الربح الموزع لكل وحدة خلال الربع المعني	لا يوجد
نسبة التوزيع من صافي قيمة أصول الصندوق	لا يوجد
أحقية التوزيعات النقدية التي تم توزيعها خلال الربع المعني	لا يوجد

أكبر 10 استثمارات للصندوق



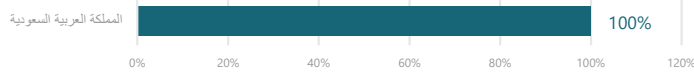
أكبر 10 استثمارات للصندوق	%
مصرف الراجحي	17.31%
الاتصالات السعودية	8.85%
شركة التعدين العربية السعودية	7.36%
شركة اتحاد اتصالات	5.19%
شركة سابك للمغذيات الزراعية	4.94%
شركة المصانع الكبرى للتعدين	3.55%
أرامكو	3.36%
شركة البابطين للطاقة والاتصالات	3.15%
شركة جرير	2.96%
سيراف القابضة	2.84%

توزيع القطاعات



توزيع القطاعات	%
المواد الأساسية	23.35%
التكنولوجيا	18.11%
خدمات الاتصالات	16.91%
السلع الرأسمالية	8.77%
الطاقة	8.09%
تجزئة وتوزيع السلع الكيماوية	7.11%
إدارة وتطوير العقارات	4.64%
التأمين	3.02%
الخدمات الاستهلاكية	2.85%
الرعاية الصحية	2.27%
النقل	1.50%
الأدوية	1.06%
التطبيقات وخدمات التقنية	1.05%
الخدمات التجارية والمهنية	0.39%
تجزئة وتوزيع السلع الاستهلاكية	0.37%
النقد	0.32%
المرافق العامة	0.19%

التوزيع الجغرافي



التوزيع الجغرافي	%
المملكة العربية السعودية	100%

بيانات الاتصال

رقم الهاتف	8001243232
الموقع الإلكتروني	https://bsfcapital.sa/
البريد الإلكتروني	complaints@bsfcapital.sa

إخلاء مسؤولية

الأداء الموضح في التقرير ليس مؤشراً ولا ضماناً للعوائد المستقبلية حيث أن قيمة الوحدات عرضة لتقلبات الأسعار لذا يمكن أن ترتفع قيمة الوحدات؛ ننصح المستثمرون بالنظر في أوضاعهم الفردية والمالية ومدى ملائمة المنتج لأهدافهم الاستثمارية والحصول على المشورة من الخبراء المختصين في مجالات الاستثمار.
* أكبر عشر إستثمارات للصندوق وقطاعات الصندوق هي كما في بداية الربع المعني.